

УТВЕРЖДЕНЫ
решением Совета директоров
Акционерного общества
«Санкт-Петербургская
Валютная Биржа»
(протокол от 02.06.2022г. №369)

**Правила клиринга
Акционерного общества
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»
(новая редакция)**

Оглавление

1.	Общие положения	4
1.1.	Термины и определения	4
1.2.	Основные сведения о клиринговой деятельности АО СПВБ и раскрытие иной информации	9
1.3.	Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев	10
1.4.	Утверждение, изменение и дополнение Правил клиринга	10
1.5.	Конфиденциальность информации	11
1.6.	Порядок документооборота при осуществлении клиринга	12
2.	Договор об оказании клиринговых услуг	12
2.1.	Предмет Договора	12
2.2.	Заключение и расторжение Договора	12
2.3.	Ответственность Клиринговой организации и Участника клиринга ..	14
2.4.	Порядок разрешения споров между Клиринговой организацией и Участником клиринга	14
3.	Требования к Участникам клиринга	15
3.1.	Категории Участников клиринга	15
3.2.	Требования к кандидатам в Участники клиринга	16
3.3.	Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга	18
3.4.	Порядок приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	19
4.	Права и обязанности Клиринговой организации и Участников клиринга	21
4.1.	Обязанности Клиринговой организации	21
4.2.	Права Клиринговой организации	22
4.3.	Обязанности Участника клиринга	22
4.4.	Права Участника клиринга	23
5.	Порядок проведения клиринга	23
5.1.	Порядок и условия допуска обязательств к клирингу	23
5.2.	Порядок проведения клиринга (кроме клиринга Договоров поставки товара). Расчет нетто-обязательств и нетто-требований	25
5.3.	Процедура контроля обеспечения	26
5.4.	Порядок и условия исключения Обязательств из клирингового пула ..	27
5.5.	Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга (кроме обязательств из Договоров поставки товара)	29
5.6.	Порядок проведения сверки результатов расчетов	32
5.7.	Порядок действий в случае расхождения данных при сверке	32
5.8.	Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением	33
5.9.	Порядок проведения клиринга и исполнения обязательств по договорам с Биржевым товаром (Договорам поставки товара)	35
6.	Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу	38
6.1.	Индивидуальное клиринговое обеспечение	38
7.	Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним	40

7.1. Виды торговых и клиринговых счетов.....	40
7.2. Порядок проведения операций по торговым банковским счетам	41
7.3. Порядок проведения операций по торговым счетам депо и Специальному техническому счету.....	44
7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам	45
8. Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения.....	46
8.1. Клиринговые регистры учета ценных бумаг	46
8.2. Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам.....	47
8.3. Клиринговые регистры учета денежных средств.....	49
8.4. Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам.....	51
8.5. Порядок ведения клиринговых регистров.....	51
8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета АО СПВБ	54
9. Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга.....	55
9.1. Формы отчетов	55
9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга	56
10. Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга.....	56
10.1. Система управления рисками	56
10.2. Документы АО СПВБ по управлению рисками	57
10.3. Общие принципы управления рисками.....	57
10.4. Порядок установления лимитов по допустимому объему договоров	58
11. Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях	59
12. Оплата клиринговых услуг	59
13. Взаимодействие с Биржами, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием	61
13.1. Порядок взаимодействия с Биржами.....	61
13.2. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией.....	61
13.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием.	62
Приложение №1 к Правилам клиринга Акционерного общества «Санкт- Петербургская Валютная Биржа»	64

1. Общие положения

1.1. Термины и определения

1.1.1. АО СПВБ – Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», Клиринговая организация.

1.1.2. Биржа – Организатор торговли, действующий на основании лицензии биржи. В целях настоящих Правил клиринга под Биржей понимается АО СПВБ, осуществляющее деятельность организатора торговли, или Акционерное общество «Биржа «Санкт – Петербург» (АО «Биржа «Санкт - Петербург»), заключившее договор о взаимодействии с Клиринговой организацией АО СПВБ.

1.1.3. Биржевой инструмент – ценная бумага, товар или иностранная валюта, допущенные к торгам на Бирже, либо договор, заключаемый на Бирже на условиях одной Спецификации (в том числе – депозитный договор, кредитный договор, договор РЕПО и пр.). Биржа присваивает каждому Биржевому инструменту уникальный код (тикер).

1.1.4. Биржевой товар (товар) – товар, допущенный АО «Биржа «Санкт - Петербург» к организованным торгам в порядке, установленном Правилами организованных торгов АО «Биржа «Санкт - Петербург».

1.1.5. Внутренние документы Биржи – Правила организованных торгов АО СПВБ, Спецификации Биржевых инструментов, Спецификации Биржевых товаров, а также иные внутренние документы Биржи, регламентирующие деятельность по организации торгов, утвержденные Биржей в установленном порядке.

1.1.6. Внутренние документы Клиринговой организации – «Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Внутренний регламент клиринговой организации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Регламент осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к Клиринговому обслуживанию Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», «Регламент учета и регистрации документов клиринговой организации Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» и иные внутренние документы АО СПВБ, регламентирующие клиринговую деятельность.

1.1.7. Внутренний регламент Клиринговой организации – документ «Внутренний регламент клиринговой организации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», утверждаемый Правлением АО СПВБ.

1.1.8. Гарантийное обеспечение – индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в ценных бумагах, и/или денежных средствах, которое используется для исполнения обязательств Участников клиринга, допущенных к клирингу в соответствии с Правилами клиринга. Требование по внесению гарантийного обеспечения не распространяется на Банк России.

1.1.9. Генеральное соглашение (единый договор) – документ, содержащий отдельные условия для заключения более чем одного договора на организованных торгах, проводимых Биржей.

Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

1.1.10. Дата завершения поставки – дата, определяемая внутренними документами Биржи как последний день периода поставки по Договору поставки товара.

1.1.11. Дата обеспечения – дата, определяемая внутренними документами Биржи, в которую должно быть полностью обеспечено исполнение денежных обязательств Покупателя по Договору поставки товара в порядке, предусмотренном Договором поставки товара и Правилами клиринга.

1.1.12. Держатель – организация, осуществляющая на основании лицензии на осуществление депозитарной деятельности депозитарное обслуживание Участников клиринга, имеющая торговые счета депо в Расчетном депозитории для проведения операций с ценными бумагами Участников клиринга и/или их клиентов по результатам заключенных Участниками клиринга договоров.

1.1.13. Договор поставки товара – зарегистрированный Биржей договор купли-продажи Биржевого товара, условиями которого предусматривается проведение клиринга Клиринговой организацией в соответствии с Правилами клиринга.

1.1.14. Клиринговая организация – АО СПВБ.

1.1.15. Клиринговый пул – совокупность обязательств, допущенных к клирингу и подлежащих полностью прекращению зачетом и (или) иным способом в соответствии с Правилами клиринга и (или) исполнением.

1.1.16. Инициатор торгов – Участник торгов, по инициативе которого Биржа утверждает Спецификацию Биржевого инструмента с целью проведения торгов в отношении данного Биржевого инструмента, в ходе которых остальные Участники торгов могут подавать заявки, адресованные только ему, и заключать договоры только с ним.

1.1.17. Клиринг – определение подлежащих исполнению обязательств, возникших из договоров, в том числе в результате неттинга обязательств, и подготовка документов (информации), являющихся основанием прекращения и (или) исполнения таких обязательств, а также обеспечение исполнения таких обязательств.

1.1.18. Клиринг с полным обеспечением – клиринг обязательств из договора, условием заключения которого является наличие ценных бумаг / денежных средств Участника клиринга и/или требования Участника клиринга по получению ценных бумаг / денежных средств с датой обеспечения не позднее, чем дата обеспечения обязательств по заключаемому договору, в размере, необходимом для исполнения обязательств по такому договору в полном объеме.

1.1.19. Клиринг с частичным обеспечением – клиринг обязательств из договора, условием заключения которого является наличие Гарантийного обеспечения в пределах лимитов по допустимому объему договоров, определенных Клиринговой организацией в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

1.1.20. Клиринг без предварительного обеспечения – клиринг обязательств из договора, при заключении которого не проверяется наличие обеспечения.

1.1.21. Клиринговая сессия – период рабочего дня, в течение которого Клиринговой организацией проводится клиринг обязательств.

1.1.22. Клиринговая система – совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения Клиринговой организации, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности в соответствии с Правилами клиринга.

1.1.23. Клиринговое обслуживание – оказание клиринговых услуг Участникам клиринга.

1.1.24. Код расчетов T0 – код расчетов, определяющий, что при подаче заявки проводится контроль обеспечения обязательств, подлежащих исполнению, а датой исполнения обязательств по договору является дата заключения договора.

1.1.25. Код расчетов Вn – код расчетов, определяющий, что при подаче заявки контроль обеспечения не проводится, а датой исполнения обязательств по договору является дата, определяемая как T+n, где T – дата заключения договора, а n – число календарных дней.

1.1.26. Код участника клиринга – уникальный буквенно-цифровой код Участника клиринга, клиента Участника клиринга, соответствующий требованиям законодательства Российской Федерации, присваиваемый Клиринговой организацией Участнику клиринга, клиенту Участника клиринга и однозначно определяющий Участника клиринга или клиента Участника клиринга.

1.1.27. Контролер поставки – категория Участника торгов, присвоенная Участнику торгов Биржевыми товарами в соответствии с Внутренними документами Биржи.

1.1.28. Неттинг – полное или частичное прекращение обязательств, допущенных к клирингу, зачетом и (или) иным способом, установленным Правилами клиринга.

1.1.29. Нетто-обязательство Участника клиринга – обязательство Участника клиринга, определенное в ходе проведения клиринговой сессии в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

1.1.30. Нетто-требование Участника клиринга – требование Участника клиринга, определенное в ходе проведения клиринговой сессии в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

1.1.31. Неустойка по Договору поставки товара (Неустойка) – сумма денежных средств, подлежащая уплате Участником клиринга в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) им своих обязательств своему контрагенту по Договору поставки товара.

1.1.32. Обязательства клиента – обязательства Участника клиринга, исполнение которых осуществляется за счет зарегистрированного Клиринговой организацией клиента Участника клиринга.

1.1.33. Отдельный специальный торговый счет – торговый счет Участника клиринга, открытый им в Расчетной организации для учета обеспечения

клиента, зарегистрированного Клиринговой организацией в порядке, установленном п.3.3.6, 3.3.8 настоящих Правил клиринга.

1.1.34. Официальный сайт АО СПВБ – официальный сайт АО СПВБ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу <http://www.spvb.ru>.

1.1.35. Покупатель – Участник клиринга, являющийся стороной по договору купли-продажи ценных бумаг или стороной Договора поставки товара, имеющий требования по поставке ценных бумаг или Биржевого товара.

1.1.36. Положение о формах и форматах документов Клиринговой организации – документ «Положение о формах и форматах документов АО СПВБ», утверждаемое Правлением АО СПВБ.

1.1.37. Поручение – документ, содержащий инструкции Расчетному депозитарию и служащий основанием для выполнения депозитарной операции или группы связанных депозитарных операций.

1.1.38. Правила клиринга – настоящие Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

1.1.39. Продавец (Поставщик) – Участник клиринга, являющийся стороной по договору купли-продажи ценных бумаг или стороной Договора поставки товара и имеющий обязательства по поставке ценных бумаг или Биржевого товара.

1.1.40. Раздел «к размещению/выкупу» – отдельный раздел, открытый Расчетным депозитарием на Специальном техническом счете, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги, используемый для проведения операций при размещении/выкупе ценных бумаг. Режим использования Раздела «к размещению/выкупу» специального технического счета определен п. 5.5.11 Правил клиринга.

1.1.41. Расчетная организация – кредитная организация, осуществляющая операции, связанные с исполнением обязательств по передаче денежных средств по итогам клиринга обязательств из заключенных на Бирже договоров на основании договора с Биржей. Наименование Расчетной организации указывается в Спецификации Биржевого инструмента, а также раскрывается на Официальном сайте АО СПВБ.

1.1.42. Расчетный депозитарий – депозитарий, имеющий лицензию Банка России на право осуществления депозитарной деятельности, осуществляющий операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга обязательств из договоров, заключенных на Бирже. Наименование Расчетного депозитария указывается в Спецификации Биржевого инструмента, а также раскрывается на Официальном сайте АО СПВБ в соответствии с действующим законодательством.

1.1.43. Регламент осуществления допуска Клиринговой организации – документ «Регламент осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Акционерного общества

«Санкт-Петербургская Валютная Биржа», утверждаемый решением Правления АО СПВБ.

1.1.44. Свободные денежные средства – денежные средства, учтенные на Клиринговых регистрах, свободные от исполнения обязательств по заключенным договорам.

1.1.45. Секция межбанковского кредитного рынка (Секция МКР) – торговая (биржевая) секция, в которой проводятся организованные торги по привлечению / размещению денежных средств в соответствии с Правилами торгов в Секции МКР.

1.1.46. Специальный торговый счет – специальный торговый банковский счет Участника клиринга, открытый им в Расчетной организации, для совершения операций с денежными средствами его клиента. Денежные средства, учитываемые (находящиеся) на указанном специальном торговом банковском счете, могут использоваться только для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу и возникших из договоров, заключенных за счет такого клиента

1.1.47. Специальный технический счет (технический субсчет) – счет (субсчет) открытый в Расчетном депозитарии, предназначенный для исполнения обязательств по итогам Клиринга. Счет (субсчет) не предназначен для учета прав на ценные бумаги. Остаток ценных бумаг на техническом счете/субсчете депо после проведения операций по итогам клиринга не допускается¹.

1.1.48. Спецификация Биржевого инструмента (Спецификация) – утвержденный Правлением Биржи документ, содержащий стандартные условия (параметры) заключения договоров купли-продажи ценных бумаг либо стандартные условия (параметры) заключения депозитного договора, кредитного договора, договора РЕПО. Группа однотипных Биржевых инструментов может быть описана одной Спецификацией.

1.1.49. Спецификация Биржевого товара (Спецификация) – документ АО «Биржа «Санкт - Петербург», определяющий условия Договора поставки товара или порядок их определения.

1.1.50. Тарифы АО СПВБ – документ, утверждаемый Советом директоров АО СПВБ, содержащий размер и порядок оплаты клиринговых услуг АО СПВБ, который раскрывается на Официальном сайте АО СПВБ в соответствии с законодательством Российской Федерации.

1.1.51. Торговая сессия (торги) – период торгового дня, в течение которого Участниками торгов в режимах, предусмотренных Правилами организованных торгов АО СПВБ, подаются адресные и безадресные заявки и заключаются договоры.

1.1.52. Торгово-клиринговый регистр (ТКР) – уникальный буквенно-цифровой код, однозначно определяющий взаимосвязь торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга.

¹ Предусмотрен Условиями осуществления депозитарной деятельности (клиентский регламент) Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургский Расчетно-Депозитарный Центр».

1.1.53. Участник клиринга – лицо, заключившее с АО СПВБ договор об оказании клиринговых услуг.

1.1.54. Фондовая секция – торговая (биржевая) секция, в которой проводятся организованные торги ценными бумагами в соответствии с Правилами торгов в Фондовой секции.

1.1.55. Термины и определения, специально не определенные в настоящих Правилах клиринга, используются в значениях, установленных Правилами организованных торгов АО СПВБ, а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.2. Основные сведения о клиринговой деятельности АО СПВБ и раскрытие иной информации

1.2.1. Клиринг в соответствии с настоящими Правилами клиринга осуществляется без участия центрального контрагента.

1.2.2. Клиринговая организация осуществляет раскрытие информации на Официальном сайте АО СПВБ согласно требованиям законодательства Российской Федерации о раскрытии информации.

1.2.3. Клиринговая организация в соответствии с настоящими Правилами клиринга осуществляет клиринг обязательств из следующих договоров:

1.2.3.1. договоров купли-продажи ценных бумаг, заключенных в Фондовой секции;

1.2.3.2. депозитных договоров, заключенных в Секции МКР;

1.2.3.3. кредитных договоров, заключенных в Секции МКР;

1.2.3.4. договоров поставки товара, заключенных на организованном рынке АО «Биржа «Санкт - Петербург».

1.2.4. Клиринговая организация осуществляет определение Нетто-обязательств / Нетто-требований каждого из Участников клиринга и организует расчеты по договорам купли-продажи ценных бумаг по всем совершенным от имени данного Участника клиринга договорам с единой датой исполнения обязательств.

1.2.5. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует расчеты по кредитным договорам в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга кредитного договора.

1.2.6. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует расчеты по депозитным договорам в зависимости от условий, определенных соответствующей Спецификацией Биржевого инструмента.

1.2.7. Клиринговая организация осуществляет определение обязательств каждого из Участников клиринга и организует расчеты по договорам поставки товара в отношении каждого заключенного от имени Участника клиринга договора поставки товара.

1.2.8. Клиринговая организация осуществляет в отношении договоров с кодом расчетов «Т0» клиринг с полным обеспечением.

1.2.9. Клиринговая организация осуществляет в отношении договоров с кодом расчетов «Вп» клиринг без предварительного обеспечения.

1.2.10. Клиринговая организация осуществляет клиринг договоров, заключенных в Секции МКР, в пределах установленных АО СПВБ лимитов допустимых объемов договоров.

1.2.11. Клиринговая организация допускает к Клирингу договоры с Биржевым товаром в пределах, определенных АО СПВБ лимитов допустимых объемов договоров (клиринг с частичным обеспечением).

1.2.12. Клиринговая организация оказывает клиринговые услуги и проводит клиринговые сессии в соответствии с Расписанием предоставления клиринговых услуг, утверждаемым Правлением АО СПВБ, раскрываемом на Официальном сайте АО СПВБ, по рабочим дням в соответствии с нормативными правовыми актами Российской Федерации. В случае необходимости продолжительность работы Клиринговой организации может быть изменена по решению Правления АО СПВБ.

1.3. Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев

1.3.1. Список Расчетных организаций и Расчетных депозитариев опубликован на Официальном сайте АО СПВБ, согласно требованиям законодательства Российской Федерации о раскрытии информации.

1.3.2. Участники клиринга не менее чем за месяц уведомляются о предполагаемых изменениях в списке Расчетных организаций и Расчетных депозитариев путем направления в их адрес письменного уведомления о намерении Клиринговой организации расторгнуть договорные отношения с Расчетным депозитарием / Расчетной организацией и размещением информации об этом событии на Официальном сайте АО СПВБ.

1.4. Утверждение, изменение и дополнение Правил клиринга

1.4.1. Настоящие Правила клиринга разработаны в соответствии с законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России, Уставом АО СПВБ и иными Внутренними документами Клиринговой организации.

1.4.2. Настоящие Правила клиринга и изменения к ним утверждаются Советом директоров АО СПВБ и подлежат регистрации в Банке России в соответствии с законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России.

1.4.3. Изменения в настоящие Правила клиринга вносятся Клиринговой организацией в одностороннем порядке, за исключением внесения изменений в настоящие Правила клиринга, затрагивающие операции Участника клиринга категории «Ц». В последнем случае планируемые изменения в настоящие Правила клиринга подлежат предварительному согласованию с Участником клиринга категории «Ц».

1.4.4. Настоящие Правила клиринга и изменения к настоящим Правилам клиринга вступают в силу после выполнения следующих условий:

1.4.4.1. регистрация в Банке России;

1.4.4.2. раскрытие информации о Правилах клиринга или изменений к ним более чем за 5 (пять) дней до даты вступления в силу, если законодательством Российской Федерации, требованиями нормативных актов Банка России не установлен более длительный срок между моментом раскрытия информации о Правилах клиринга и вступлением в силу Правил клиринга и изменений к ним;

1.4.4.3. наступление даты вступления в силу, определенной Советом директоров АО СПВБ или по поручению Совета директоров АО СПВБ – Правлением АО СПВБ.

1.4.5. Клиринговая организация раскрывает информацию о настоящих Правилах клиринга и изменениях к ним путем размещения их на Официальном сайте АО СПВБ после регистрации Банком России.

1.5. Конфиденциальность информации

1.5.1. Клиринговая организация и Участник клиринга обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг, условия заключенных договоров, как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам, за исключением аудиторов Участника клиринга и Клиринговой организации, уполномоченных государственных органов, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации, если иное специально не согласовано Участником клиринга и Клиринговой организацией.

1.5.2. Любые документы, представленные и подготовленные Участником клиринга и/или Клиринговой организацией для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, рассматриваются как конфиденциальные.

1.5.3. Клиринговая организация обязана обеспечить конфиденциальность информации, о которой стало известно в связи с оказанием клиринговых услуг:

1.5.3.1. информации, составляющей коммерческую, банковскую и иную охраняемую законом тайну;

1.5.3.2. информации об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг;

1.5.3.3. информации о торговых банковских счетах, торговых счетах депо, Разделах «к размещению/выкупу», Клиринговых счетах (регистрах внутреннего учета средств на Клиринговом счете) и информации об операциях по указанным счетам;

1.5.3.4. информации о финансовом состоянии Участника клиринга;

1.5.3.5. содержания документов, полученных от Участника клиринга, согласно требованиям п.3.2 настоящих Правил клиринга.

1.5.4. Клиринговая организация не имеет права передавать указанную выше информацию третьим лицам без письменного согласия Участника клиринга за
Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

исключением случаев, предусмотренных законодательством Российской Федерации и/или требованиями нормативных актов Банка России.

1.5.5. Участники клиринга подтверждают, что все персональные данные, передаваемые Участником клиринга/юридическим лицом и Клиринговой организацией друг другу в соответствии с настоящими Правилами клиринга, в случае если это требуется в целях исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, достоверны и получены от субъекта персональных данных в законном порядке и передаются с согласия субъекта персональных данных, в случае если такое согласие предусмотрено законодательством Российской Федерации.

1.6. Порядок документооборота при осуществлении клиринга

1.6.1. Обмен информацией и документами в электронной форме осуществляется в соответствии с заключенным с Участником клиринга Договором об участии в системе электронного документооборота АО СПВБ, если иное прямо не предусмотрено Правилами клиринга.

1.6.2. Для обмена электронными документами с Клиринговой организацией Участник клиринга может использовать СЭД АО СПВБ и/или SWIFT.

1.6.3. Организация электронного документооборота и использование того или иного канала информационного взаимодействия с Клиринговой организацией, порядок использования электронной подписи и других аналогов собственноручной подписи, кодов, паролей и иных средств, обеспечивающих авторство, целостность и конфиденциальность электронных документов, определены Договором об участии в системе электронного документооборота АО СПВБ и Правилами электронного документооборота АО СПВБ. Типовая форма Договора об участии в системе электронного документооборота АО СПВБ и Правила электронного документооборота АО СПВБ размещены на Официальном сайте АО СПВБ.

2. Договор об оказании клиринговых услуг

2.1. Предмет Договора

2.1.1. По Договору об оказании клиринговых услуг Клиринговая организация обязуется оказывать Участнику клиринга клиринговые услуги, а Участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги, за исключением случаев, установленных законодательством Российской Федерации.

2.1.2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с оказанием клиринговых услуг, устанавливаются настоящими Правилами клиринга.

2.2. Заключение и расторжение Договора

2.2.1. Участник клиринга присоединяется к условиям Договора об оказании клиринговых услуг, определенным настоящими Правилами клиринга, путем подписания Договора об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной в Приложении № 1 к настоящим Правилам клиринга, а также выполняет иные требования, изложенные в разделе 3 настоящих Правил клиринга.

2.2.2. Договор об оказании клиринговых услуг вступает в силу с момента подписания и действует до 31 декабря года подписания. В случае если ни одна из

сторон не позднее, чем за 30 (тридцать) рабочих дней до окончания указанного срока действия, не заявила в письменном виде о своем желании расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг, срок действия Договора об оказании клиринговых услуг считается автоматически продленным на следующий календарный год на тех же условиях.

2.2.3. Договор об оказании клиринговых услуг может быть расторгнут до окончания срока его действия по письменному заявлению одной из сторон, направленному в адрес другой стороны.

2.2.4. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг (расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг) только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также не исполненных им обязательств, допущенных к клирингу.

2.2.5. Клиринговая организация вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга (расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг) в случае нарушения им требований, предъявляемых Правилами клиринга к Участникам клиринга в порядке, установленном пунктом 2.2.6 настоящих Правил клиринга. При этом возмещение убытков, связанных с таким отказом, Клиринговой организацией Участнику клиринга не осуществляется.

2.2.6. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, предусмотренном разделом 3.4 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация расторгает Договор об оказании клиринговых услуг в одностороннем порядке, при этом:

2.2.6.1. при отсутствии на дату принятия решения об отказе от Договора об оказании клиринговых услуг обязательств Участника клиринга, Договор об оказании клиринговых услуг прекращается в день, следующий за днем принятия указанного решения;

2.2.6.2. при наличии обязательств Участника клиринга, возникших до принятия Клиринговой организацией решения об отказе от Договора об оказании клиринговых услуг, Договор об оказании клиринговых услуг прекращается в день, следующий за днем завершения проведения клиринга и осуществления расчетов по обязательствам Участника клиринга.

2.2.6.3. Прекращение Договора об оказании клиринговых услуг по основаниям, указанным в настоящем пункте, не требует предварительного уведомления Участника клиринга. Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия решения об отказе от Договора об оказании клиринговых услуг в одностороннем порядке, информирует Участника клиринга о принятом решении. Информирование осуществляется способом, предусмотренным п.9.2 настоящих Правил клиринга. Дополнительно Участнику клиринга направляется Уведомление по электронной почте.

2.2.6.4. В случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг Участнику клиринга возвращаются имущество, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, или денежные средства. Клиринговая организация возвращает Участнику клиринга денежные средства не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании

клиринговых услуг. При этом Клиринговая организация обеспечивает принятие обоснованных и доступных ей в сложившихся обстоятельствах мер, направленных на возврат Участнику клиринга денежных средств, являющихся индивидуальным клиринговым обеспечением. Обязательство Клиринговой организации по возврату денежных средств считается исполненным с момента формирования и передачи в Расчетную организацию Распоряжения Клиринговой организации на возврат денежных средств Участнику клиринга с использованием банковских реквизитов, указанных в Анкете данного Участника клиринга, предоставляемой в соответствии с разделом 3.2.3.2. настоящих Правил клиринга.

2.3. Ответственность Клиринговой организации и Участника клиринга

2.3.1. Клиринговая организация и Участники клиринга несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с законодательством Российской Федерации и настоящими Правилами клиринга.

2.3.2. Клиринговая организация в договорах с Расчетными депозитариями и Расчетными организациями предусматривает ответственность за:

2.3.2.1. неисполнение Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием распоряжений Клиринговой организации на проведение операций по торговым банковским счетам, клиринговым банковским счетам и/или по торговым счетам депо и Специальному техническому счету, произошедшее по их вине;

2.3.2.2. последствия действий или бездействия Расчетной организации и/или Расчетного депозитария после получения ими согласия на совершение операции по торговым банковским счетам и по торговым счетам депо, соответственно, в случае наличия их вины;

2.3.2.3. последствия неисполнения Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием по их вине своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой в Клиринговую организацию.

2.3.3. Клиринговая организация не несет ответственности:

2.3.3.1. по обязательствам Участника клиринга перед третьими лицами;

2.3.3.2. за неисполнение Клиринговой организацией своих обязанностей в результате ненадлежащего исполнения Участником клиринга своих обязанностей в соответствии с настоящими Правилами клиринга, вызванное действием или бездействием Участника клиринга;

2.3.3.3. за неисполнение Биржей, Участником клиринга, являющимся Контролером поставки, своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой в Клиринговую организацию.

2.4. Порядок разрешения споров между Клиринговой организацией и Участником клиринга

2.4.1. Все споры и разногласия, вытекающие из Договора об оказании клиринговых услуг или в связи с ним, в том числе касающиеся его исполнения,

нарушения или действительности, решаются Клиринговой организацией и Участником клиринга путем переговоров.

2.4.2. Клиринговая организация и Участник клиринга обязаны соблюдать претензионный порядок урегулирования споров и разногласий, возникающих из Договора об оказании клиринговых услуг.

2.4.3. Претензия направляется второй стороне в письменном виде и должна быть подписана уполномоченным представителем стороны. Претензия должна содержать:

- 2.4.3.1. изложение требований заявителя;
- 2.4.3.2. указание суммы претензии и ее расчет (если претензия подлежит денежной оценке);
- 2.4.3.3. изложение обстоятельств, на которых основываются требования заявителя;
- 2.4.3.4. доказательства, подтверждающие их, со ссылкой на соответствующие нормы материального права;
- 2.4.3.5. перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;
- 2.4.3.6. иные сведения, необходимые для урегулирования спора.

2.4.4. Претензия в отношении результатов Клиринга может быть направлена Участником клиринга в адрес Клиринговой организации не позднее следующего рабочего дня после дня предоставления отчетов в соответствии с разделом 9 настоящих Правил клиринга.

2.4.5. Сторона, получившая претензию, обязана рассмотреть ее в срок, не превышающий 10 (десять) рабочих дней с даты получения претензии, и предоставить отправителю претензии мотивированный отказ либо согласие на удовлетворение претензионных требований.

2.4.6. В случае, если сторонам не удалось разрешить спор путем переговоров, спор подлежит передаче для разрешения в Арбитражный суд по месту нахождения ответчика в соответствии с законодательством Российской Федерации.

3. Требования к Участникам клиринга

3.1. Категории Участников клиринга

3.1.1. Клиринговая организация в соответствии с настоящими Правилами клиринга устанавливает для Участников клиринга следующие категории:

- 3.1.1.1. категория «Ц»;
- 3.1.1.2. категория «Ф»;
- 3.1.1.3. категория «И»;
- 3.1.1.4. категория «Б»;
- 3.1.1.5. категория «В»;
- 3.1.1.6. категория «Т»;
- 3.1.1.7. категория «К».

3.1.2. Участник клиринга принадлежит к категории «Ц», если он является Банком России.

3.1.3. Участник клиринга принадлежит к категории «Ф», если он является профессиональным участником рынка ценных бумаг и заключает договоры с ценными бумагами в Фондовой секции.

3.1.4. Участник клиринга принадлежит к категории «Б», если он является кредитной организацией, созданной в соответствии с законодательством Российской Федерации, и допущен к торгам в Секции МКР.

3.1.5. Участник клиринга принадлежит к категории «И», если он является Инициатором торгов в соответствии с Внутренними документами Биржи и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга свой торговый банковский счет, открытый в Расчетной организации.

3.1.6. Участник клиринга принадлежит к категории «В», если он является Инициатором торгов в соответствии с Внутренними документами Биржи и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, учитываемые на клиринговых регистрах, предназначенных для учета средств, зачисленных на клиринговый счет АО СПВБ.

3.1.7. Участник клиринга принадлежит к категории «Т», если он является Участником торгов на товарном рынке в соответствии с Внутренними документами Биржи и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, учитываемые на счете внутреннего учета, зарегистрированном для Участника клиринга на клиринговом счете АО СПВБ.

3.1.8. Участник клиринга принадлежит к категории «К», если он является участником торгов на товарном рынке, является Контролером поставки по Биржевому товару в соответствии с Внутренними документами Биржи и использует для исполнения обязательств по итогам клиринга средства, учитываемые на счете внутреннего учета, зарегистрированном для Участника клиринга на клиринговом счете АО СПВБ. Требования, права и обязанности Участников клиринга категории «К», указанные в Правилах клиринга в отношении таких Участников клиринга, в том числе требования по обеспечению исполнения обязательств, допущенных к клирингу, отличаются от требований к Участникам клиринга категории «Т» только в случаях клирингового обслуживания по договорам с Биржевыми товарами, по которым Участник клиринга категории «К» выполняет функции Контролера поставки. В иных случаях такой Участник клиринга признается Участником клиринга категории «Т».

3.1.9. Один Участник клиринга может принадлежать одновременно к нескольким категориям Участников клиринга, если он удовлетворяет требованиям настоящих Правил клиринга, предъявляемым к таким Участникам клиринга.

3.2. Требования к кандидатам в Участники клиринга

3.2.1. Участником клиринга могут стать индивидуальные предприниматели и юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, в том числе кредитная организация, Банк России, государственная корпорация, банк-нерезидент или международная организация.

3.2.2. Кандидат в Участники клиринга должен быть Участником торгов АО СПВБ (Кандидат в Участники клиринга с категориями «Ф», «Б», «И», «В») или

Участником торгов АО «Биржа «Санкт – Петербург» (Кандидат в Участники клиринга с категориями «Т», «К»).

3.2.3. Кандидат в Участники клиринга обязан выполнить следующие требования:

3.2.3.1. присоединиться к Договору об оказании клиринговых услуг, условия которого предусмотрены настоящими Правилами клиринга, путем подписания Договора об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной Приложением № 1 настоящих Правил (в двух экземплярах);

3.2.3.2. предоставить Клиринговой организации заполненную Анкету по форме, предусмотренной Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации (далее – Анкета Участника клиринга), и иные документы в зависимости от категории, перечень которых предусмотрен Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации.

3.2.4. Дополнительно Кандидаты в Участники клиринга обязаны выполнить следующие требования в зависимости от категории:

3.2.4.1. Для получения категории «Ф»:

- открыть торговые банковские счета в Расчетной организации;
- открыть торговые счета депо в Расчетном депозитарии;
- предоставить Клиринговой организации Уведомление о взаимосвязи торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга по форме, предусмотренной Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации. При этом Участником клиринга может быть установлена взаимосвязь между торговым банковским счетом и торговым счетом депо, предназначенными для учета собственных средств Участника клиринга, либо между торговым банковским счетом и торговым счетом депо, предназначенными для учета клиентских средств Участника клиринга.

3.2.4.2. Для получения категорий «И» или «Б» – открыть торговые банковские счета в Расчетной организации.

3.2.4.3. Для получения категории «К» – внести на клиринговый счет АО СПББ Гарантийное обеспечение в размере 1 000 000 (одного миллиона) рублей Российской Федерации.

3.2.5. Клиринговая организация вправе потребовать от Участника клиринга предоставления дополнительных документов. Участник клиринга обязан предоставить данные документы в срок, указанный в запросе, но не более 3 (трех) рабочих дней со дня получения запроса от Клиринговой организации.

3.2.6. Кандидаты в Участники клиринга также обязаны представить иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговой организацией в необходимых случаях в целях, не противоречащих законодательству Российской Федерации и требованиям нормативных актов Банка России.

3.2.7. С целью получения информации о юридическом лице Клиринговая организация вправе использовать сведения (информацию) о юридическом лице из официальных источников, в том числе электронного сервиса Федеральной налоговой службы.

3.2.8. Если Кандидат в Участники клиринга ранее предоставил АО СПВБ один или несколько из требуемых документов и указанные документы действительны на дату запроса Клиринговой организации, то он освобождается от повторного предоставления указанных документов.

3.3. Порядок регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга

3.3.1. Клиринговая организация на основании предоставленной Участниками клиринга информации осуществляет регистрацию Участников клиринга с присвоением каждому Участнику клиринга регистрационного кода в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России, позволяющего идентифицировать Участника клиринга.

3.3.2. Клиринговая организация осуществляет регистрацию Участника клиринга согласно Регламенту осуществления допуска Клиринговой организации.

3.3.3. В случае, если Участник клиринга осуществляет доверительное управление, данному Участнику клиринга присваиваются регистрационные коды с уникальной последовательностью символов, однозначно указывающих на то, что этот код присвоен лицу, действующему в качестве доверительного управляющего.

3.3.4. Регистрационные коды Участнику клиринга могут присваиваться на основании кодов, присвоенных этим лицам Биржей, если это не противоречит нормативным актам Банка России.

3.3.5. Клиринговая организация при регистрации Участников клиринга и клиентов Участника клиринга вносит присвоенный регистрационный код в «Реестр участников клиринга» или «Реестр клиентов участника клиринга» и информирует Участника клиринга о присвоенных регистрационных кодах в порядке, установленном разделом 9 настоящих Правил клиринга. Клиринговая организация вправе использовать сокращенный код, позволяющий идентифицировать Участника клиринга, не содержащий всех необходимых элементов регистрационного кода (код Участника клиринга).

3.3.6. В случае, если по требованию клиента Участника клиринга Участник клиринга открыл Отдельный специальный торговый счет для совершения операций с денежными средствами такого клиента, Клиринговая организация осуществляет клиринг обязательств, расчеты по которым проводятся за счет указанного клиента Участника клиринга, после регистрации такого клиента в Клиринговой системе при выполнении условий, установленных п.3.3.7 настоящих Правил клиринга.

3.3.7. Для регистрации Участником клиринга клиента, указанного в п.3.3.6 настоящих Правил клиринга, клиенту необходимо открыть торговый счет депо в Расчетном депозитарии под управлением Участника клиринга для учета индивидуального клирингового обеспечения, которое будет использоваться только для исполнения обязательств такого клиента, и предоставить Уведомление по форме, предусмотренной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации о взаимосвязи между торговыми счетами. Участником клиринга может быть установлена взаимосвязь между торговым банковским

счетом и торговым счетом депо, предназначенными для учета средств такого клиента.

3.3.8. В случае необходимости отдельного учета индивидуального клирингового обеспечения клиента Участника клиринга, планирующего размещение ценных бумаг такого клиента, Участник клиринга может открыть отдельный торговый банковский счет для совершения операций с денежными средствами такого клиента, для учета размещаемых ценных бумаг такого клиента используется Раздел «к размещению/выкупу» на Специальном техническом счете в Расчетном депозитарии.

3.3.9. В случае необходимости отдельного учета обеспечения клиента Участника клиринга категории «Т» Клиринговая организация по требованию Участника клиринга открывает счет внутреннего учета на клиринговом счете АО СПВБ для учета обеспечения, которое будет использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга, действующего в интересах такого клиента.

3.4. Порядок приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

3.4.1. Клиринговая организация вправе прекратить или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении всех обязательств, допускаемых к клирингу, или прекратить или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в отношении отдельных видов обязательств, например, обязательств из договоров на определенном рынке (в определенной биржевой Секции).

3.4.2. Допуск к клиринговому обслуживанию прекращается или приостанавливается с момента получения Клиринговой организацией информации о наличии оснований для прекращения или приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию. Обязательства Участника клиринга по договорам, совершенным после получения указанной информации, к клирингу не допускаются, допуск обязательств возобновляется после возобновления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

3.4.3. Клиринговая организация не позднее рабочего дня, следующего за днем прекращения или приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, информирует Участника клиринга о данном факте. Информирование осуществляется в порядке, установленном разделом 9 настоящих Правил клиринга.

3.4.4. В случае если допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию был приостановлен, допуск возобновляется на следующий рабочий день после установления факта прекращения действия оснований приостановления допуска, указанных в настоящих Правилах клиринга.

3.4.5. Клиринговая организация информирует Участника клиринга о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию в порядке, установленном разделом 9 настоящих Правил клиринга.

3.4.6. Клиринговая организация прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по следующим основаниям:

3.4.6.1. прекращение Договора об оказании клиринговых услуг, в том числе в связи с ликвидацией Участника клиринга как юридического лица;

3.4.6.2. введение в отношении Участника клиринга любой из процедур банкротства, при этом Клиринговая организация осуществляет все действия, установленные подразделом 5.8 настоящих Правил клиринга;

3.4.6.3. отзыв у Участника клиринга категории «Ф» лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской, дилерской деятельности или деятельности по управлению ценными бумагами;

3.4.6.4. отзыв у Участника клиринга категории «Б» лицензии на осуществление банковских операций;

3.4.6.5. получение от Биржи информации о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах;

3.4.6.6. отзыв лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга, имеющего одновременно категории «Б» и «Ф».

3.4.6.7. отзыв лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг у Участника клиринга, имеющего одновременно категории «Б» и «Ф», при этом Клиринговая организация прекращает допуск к клиринговому обслуживанию только в отношении обязательств из договоров с ценными бумагами.

3.4.7. Клиринговая организация вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию частично в одной или нескольких Секциях АО СПВБ в зависимости от категории, в случае получения информации о прекращении его допуска к торгам в одной или нескольких Секциях АО СПВБ.

3.4.8. Клиринговая организация вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случае:

3.4.8.1. если в отношении Участника клиринга, имеющего категорию «Ф», приостановлено действие лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской или дилерской деятельности, или деятельности по управлению ценными бумагами;

3.4.8.2. применения Банком России в отношении Участника клиринга санкций (в том числе запрета на совершение определенных операций), делающих невозможным заключение договоров, обязательства по которым допускаются к клирингу;

3.4.8.3. блокировки (приостановления совершения операций, ареста, закрытия) в Расчетной организации или в Расчетном депозитарии торгового счета (торговых счетов) Участника клиринга, используемого (используемых) для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга. В случае блокировки не всех торговых счетов Участника клиринга возможно продолжение клирингового обслуживания в отношении тех обязательств, для исполнения и (или) обеспечения которых используются неблокированные торговые счета;

3.4.8.4. не уведомления Клиринговой организации Участником клиринга об изменении реквизитов его банковского счета согласно требованиям, установленным п.4.3.1.3 настоящих Правил клиринга, в результате чего денежные средства, перечисляемые Участнику клиринга в соответствии с настоящими

Правилами клиринга, были возвращены на клиринговый счет Клиринговой организации;

3.4.8.5. неоднократного и систематического неисполнения Участником клиринга обязательств по Договорам поставки товара. При этом неоднократность или систематическое нарушение определяются в соответствии с Внутренними документами Биржи;

3.4.8.6. неуплаты Участником клиринга категории «К» неустойки по Договору поставки товара в соответствии с требованием Клиринговой организации в соответствии с настоящими Правилами клиринга;

3.4.8.7. неоплаты Участником клиринга услуг Клиринговой организации в порядке и сроки, установленные Тарифами АО СПВБ.

3.4.9. При отсутствии у Участника клиринга категории «К» на момент начала торговой сессии Гарантийного обеспечения в размере 1 000 000 (одного миллиона) рублей Российской Федерации Клиринговая организация приостанавливает допуск такого Участника к клиринговому обслуживанию с категорией «К» и осуществляет клиринговое обслуживание такого Участника клиринга с категорией «Т».

4. Права и обязанности Клиринговой организации и Участников клиринга

4.1. Обязанности Клиринговой организации

4.1.1. Клиринговая организация обязана:

4.1.1.1. Осуществлять клиринговое обслуживание Участников клиринга в соответствии с требованиями настоящих Правил клиринга, законодательства Российской Федерации и требованиями нормативных актов Банка России.

4.1.1.2. Уведомлять Участников клиринга об изменениях и дополнениях, внесенных в настоящие Правила клиринга, путем размещения информации об их регистрации и дате вступления в силу на Официальном сайте АО СПВБ.

4.1.1.3. Вести внутренний учет средств Участников клиринга и клиентов Участников клиринга.

4.1.1.4. Осуществлять определение обязательств Участников клиринга в соответствии с настоящими Правилами клиринга.

4.1.1.5. Обеспечивать обособленный учет обязательств каждого Участника клиринга посредством ведения Клиринговых регистров.

4.1.1.6. Осуществлять определение и учет обязательств в разбивке по собственным обязательствам Участника клиринга и обязательствам его клиентов, соответственно вести Клиринговые регистры отдельно по каждому Участнику клиринга и его клиентам.

4.1.1.7. Осуществлять прием и обработку информации от Расчетного депозитария, в том числе при проведении операций по размещению ценных бумаг: об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо Участников клиринга, на разделе Специального технического счета «к размещению/выкупу», а также иную информацию, касающуюся проведения операций по торговым счетам депо Участников клиринга в Расчетном депозитарии, от Расчетной организации о размерах денежных средств на торговых счетах Участников клиринга.

4.1.1.8. Осуществлять формирование и передачу в Расчетный депозитарий - распоряжений на проведение операций по торговым счетам Участников клиринга, разделу Специального технического счета «к размещению/выкупу», в Расчетную организацию - распоряжений на проведение операций по торговым счетам Участников клиринга по итогам клиринга, а также учет и хранение данных распоряжений посредством ведения «Реестра распоряжений, направленных расчетному депозитарию» и «Реестра распоряжений, направленных расчетной организации».

4.1.1.9. Осуществлять контроль исполнения в Расчетном депозитарии и Расчетной организации распоряжений, содержащих Нетто-обязательства и Нетто-требования Участников клиринга, рассчитанные по результатам клиринга.

4.1.1.10. Осуществлять формирование отчетов по итогам клиринга для каждого Участника клиринга, в том числе в отношении обязательств из договоров, заключенных в интересах каждого зарегистрированного в порядке согласно п.3.3.6., 3.3.7. настоящих Правил клиринга клиента и их передачу Участникам клиринга в сроки, установленные разделом 9 настоящих Правил клиринга.

4.1.1.11. Организовать систему мер по хранению и защите информации.

4.1.1.12. Осуществлять дублированное хранение информации о договорах, остатках на торговых и клиринговых счетах денежных средств и ценных бумаг, результатах клиринга, переданных в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий распоряжениях.

4.1.1.13. Организовать систему управления рисками при осуществлении клиринговой деятельности.

4.1.1.14. Для обеспечения исполнения обязательств организовать использование Индивидуального клирингового обеспечения.

4.2. Права Клиринговой организации

4.2.1. Клиринговая организация имеет право:

4.2.1.1. В одностороннем порядке вносить изменения и дополнения в настоящие Правила клиринга, с учетом ограничений, установленных п.1.4.3. настоящих Правил клиринга.

4.2.1.2. Приостановить, возобновить или прекратить доступ Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, в порядке, определенном п.3.4. настоящих Правил клиринга.

4.2.1.3. Отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг в порядке, определенном п.2.2.5 настоящих Правил клиринга.

4.2.1.4. Расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг в порядке, установленном подразделом 2.2 настоящих Правил клиринга, в случае неисполнения Участником клиринга своих обязанностей.

4.3. Обязанности Участника клиринга

4.3.1. Участник клиринга обязан:

4.3.1.1. Выполнять требования настоящих Правил клиринга, незамедлительно информировать Клиринговую организацию о несоответствии указанным требованиям.

4.3.1.2. Своевременно и в полном объеме оплачивать клиринговые услуги в соответствии с Тарифами АО СПВБ.

4.3.1.3. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга или иных предоставленных Клиринговой организации документах, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговой организации Анкету Участника клиринга с обновленной информацией и подтверждающие изменения документы. Подтверждающие изменения документы могут не предоставляться Участником клиринга, если информация, содержащаяся в них, раскрывается Участниками клиринга на официальных сайтах Участников клиринга в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», либо на официальных сайтах организаций, уполномоченных для раскрытия информации о кредитных организациях, об участниках финансового рынка, о лицах, зарегистрированных в ЕГРЮЛ. В случае не предоставления Участником клиринга информации об изменениях и дополнениях в документы или предоставления им неполной или недостоверной информации об изменениях и дополнениях в документы, Клиринговая организация не несет ответственности за причиненные в связи с этим убытки Участнику клиринга.

4.3.1.4. Ежегодно до 01.07 представлять Клиринговой организации Анкету Участника клиринга.

4.3.1.5. Участник клиринга несет ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств, допущенных к клирингу, включая обязательства, исполняемые за счет клиента, независимо от способа обеспечения исполнения обязательств и наличия имущества Участника клиринга или его клиента, в том числе имущества клиента Участника клиринга, учет которого осуществляется отдельно.

4.4. Права Участника клиринга

4.4.1. Участник клиринга имеет право:

4.4.1.1. Получать клиринговые услуги в объеме и на условиях, установленных настоящими Правилами клиринга.

4.4.1.2. Расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг в порядке, установленном подразделом 2.2 настоящих Правил клиринга.

5. Порядок проведения клиринга

5.1. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу.

5.1.1. Допуск обязательств к клирингу осуществляется Клиринговой организацией на основании реестра договоров, предоставленного Клиринговой организации со стороны Биржи в соответствии с настоящими Правилами клиринга, внесением записей в соответствующие регистры после получения информации о заключенных договорах.

5.1.2. В Клиринговые пулы включаются обязательства из следующих видов договоров:

- 5.1.2.1. договоры купли-продажи ценных бумаг (далее – договоры с ценными бумагами);
- 5.1.2.2. депозитные договоры;
- 5.1.2.3. кредитные договоры;
- 5.1.2.4. договоры поставки товара.

5.1.3. Клиринговый пул формируется по обязательствам, по которым наступил срок исполнения.

5.1.4. Обязательства по договорам, заключенным в различных биржевых секциях, а также обязательства, имеющие различные условия (в том числе временные) расчетов, включаются в отдельные Клиринговые пулы. Клиринговые пулы формируются во время, установленное Внутренним регламентом Клиринговой организации.

5.1.5. При проведении клиринга Клиринговая организация осуществляет процедуру контроля обеспеченности обязательств, включаемых в Клиринговый пул (подраздел 5.3 настоящих Правил клиринга). Процедура контроля обеспечения проводится на основании информации, полученной от Расчетной организации и Расчетного депозитария. При осуществлении клиринга с частичным обеспечением обязательства допускаются к клирингу в случае их соответствия лимитам, установленным согласно подразделу 10.4 настоящих Правил клиринга.

5.1.6. Порядок приема и обработки информации от Расчетной организации, Расчетного депозитария о размерах остатков на торговых счетах Участников клиринга, на Разделе «к размещению/выкупу», клиринговых счетах АО СПВБ определяется в соответствии с подразделами 12.2, 12.3 настоящих Правил клиринга и договором Клиринговой организации с Расчетными депозитариями, Расчетными организациями и предусматривает следующие основные условия:

- 5.1.6.1. порядок доступа к информации и условия соблюдения конфиденциальности;
- 5.1.6.2. виды и форматы принимаемых и передаваемых документов;
- 5.1.6.3. сроки и порядок передачи документов;
- 5.1.6.4. полномочия работников Клиринговой организации, Расчетной организации и Расчетного депозитария, осуществляющих указанные операции;
- 5.1.6.5. порядок обработки и контроля полученной информации;
- 5.1.6.6. условия дублирования и резервирования каналов передачи информации;
- 5.1.6.7. условия и сроки хранения полученных документов.

5.1.7. Расчетная организация передает Клиринговой организации документы по торговым банковским счетам Участников клиринга и клиринговым счетам АО СПВБ в формате, согласованном в договоре между Расчетной организацией и Клиринговой организацией.

5.1.8. Расчетный депозитарий передает Клиринговой организации документы по торговым счетам депо Участников клиринга и по Разделу «к размещению/выкупу» Специального технического счета в формате, согласованном в договоре между Расчетным депозитарием и АО СПВБ.

5.1.9. Время и порядок обмена документами между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием, а также Клиринговой организацией и Расчетной организацией определяется договорами между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием, а также Клиринговой организацией и Расчетной организацией.

5.2. Порядок проведения клиринга (кроме клиринга Договоров поставки товара). Расчет нетто-обязательств и нетто-требований

5.2.1. Клиринговая организация определяет Нетто-обязательства и Нетто-требования Участников клиринга по ценным бумагам и денежным средствам (в том числе Нетто-обязательства и Нетто-требования из договоров Участника клиринга, заключенных в интересах зарегистрированных клиринговой организацией клиентов Участников клиринга) по обязательствам Участников клиринга, включенным в Клиринговый пул.

5.2.2. Нетто-обязательства (Нетто-требования) Участника клиринга по обязательствам Участника клиринга, включенным в Клиринговый пул, рассчитываются в отношении торговых счетов, Разделов «к размещению/выкупу» (каждого торгово-клирингового регистра Участника клиринга), или в отношении счетов внутреннего учета средств Участника клиринга на клиринговом счете АО СПВБ по формуле:

$НО = СТ - СО$, где:

НО - Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга.

СТ - сумма требований Участника клиринга по обязательствам, включенным в Клиринговый пул.

СО - сумма обязательств Участника клиринга по обязательствам, включенным в Клиринговый пул.

Отрицательное значение НО означает Нетто-обязательство Участника клиринга, положительное значение НО - Нетто-требование Участника клиринга по ценным бумагам и/или денежным средствам в отношении других Участников клиринга.

НО по торговому банковскому счету определяется в валюте соответствующего торгового банковского счета.

НО по счету внутреннего учета на Клиринговом счете АО СПВБ определяется в валюте соответствующего Клирингового счета АО СПВБ.

НО по торговому счету депо, по счету депо внутреннего учета, по Разделу «к размещению/выкупу» определяется в разрезе каждого выпуска ценных бумаг.

5.2.3. Для договоров купли-продажи ценных бумаг Обязательство (Требование) по ценным бумагам равно количеству ценных бумаг, проданных (купленных) в соответствии с заключенными договорами, обязательства из которых включены в Клиринговый пул. Если Участник клиринга выступает продавцом (покупателем) ценных бумаг, то у него появляется Обязательство (Требование) по ценным бумагам соответственно.

Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

5.2.4. Для договоров купли-продажи ценных бумаг Обязательство (Требование) по денежным средствам равно сумме Обязательств из договоров покупки (продажи) ценных бумаг. Если Участник клиринга выступает покупателем (продавцом) ценных бумаг, то у него появляется Обязательство (Требование) по денежным средствам, соответственно.

5.2.5. Для кредитных договоров и депозитных договоров, Обязательство (Требование) по денежным средствам в день исполнения Обязательств по предоставлению кредитов, размещению депозитов равно сумме кредитных и депозитных договоров. Если Участник клиринга размещает (привлекает) денежные средства, то у него возникает Обязательство (Требование) по денежным средствам соответственно.

5.2.6. Для кредитных договоров и депозитных договоров Обязательство (Требование) по денежным средствам в день исполнения Обязательств по возврату кредитов (депозитов) (либо их части) равно сумме (остатку суммы) выданных кредитов (размещенных депозитов) и процентов за их использование (за исключением случая, установленного п. 5.2.7 настоящих Правил клиринга), подлежащих уплате на дату исполнения Обязательств. Если Участник клиринга возвращает ранее привлеченные в кредит или депозит денежные средства, то у него возникает Обязательство по денежным средствам; если Участнику клиринга причитаются возвращаемые денежные средства, размещенные ранее на депозитах или выданные в кредит, то у него возникает Требование по денежным средствам.

5.2.7. Если документами, устанавливающими порядок расчетов по договорам с отдельными Биржевыми инструментами в Секции МКР, установлено, что определение отдельных видов Обязательств из договоров осуществляются без участия Клиринговой организации, то Обязательства Участников клиринга по данным денежным средствам определяются без учета указанных Обязательств.

5.2.8. Если документами, определяющими заключение договоров с определенным Биржевым инструментом, установлено, что комиссионное вознаграждение Биржи по договору подлежит оплате с использованием счетов в Расчетной организации, то распоряжение на оплату комиссионного вознаграждения передаются Клиринговой организацией в Расчетную организацию в дату исполнения Обязательств по уплате комиссионного вознаграждения.

5.3. Процедура контроля обеспечения

5.3.1. При формировании Клирингового пула Клиринговая организация проверяет обеспеченность ценными бумагами и денежными средствами всех Обязательств Участника клиринга, включенных в Клиринговый пул.

5.3.2. Клиринговая организация проверяет обеспеченность всех Нетто-обязательств Клирингового пула ценными бумагами путем сравнения значений Клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.2 настоящих Правил клиринга, со значениями Клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.1 настоящих Правил клиринга и содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах депо Участников клиринга, на Разделе «к размещению/выкупу» после получения данных из Расчетного депозитария. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров Обязательств.

5.3.3. В том случае, когда модули значений Нетто-обязательств Участников клиринга по ценным бумагам не превышают значения Клиринговых регистров, содержащих информацию о начальных значениях остатков по ценным бумагам на торговых счетах депо Участников клиринга, на Разделе «к размещению/выкупу» все договоры Участника клиринга считаются обеспеченными ценными бумагами.

5.3.4. Клиринговая организация проверяет обеспеченность всех Обязательств Клирингового пула денежными средствами (кроме договоров поставки Биржевых товаров) путем сравнения значений Клиринговых регистров, перечисленных в подразделе 8.4 настоящих Правил клиринга, со значениями Клиринговых регистров, перечисленных в пп. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга и содержащих информацию о сумме денежных средств, свободных от Обязательств, на торговых банковских счетах Участников клиринга или счетах внутреннего учета средств Участников клиринга на Клиринговых счетах АО СПВБ. Вычисление значений регистров, указанных в пп. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга, производится на основании значений регистров, указанных в пп. 8.3.1., 8.3.3, 8.3.4, 8.3.6 настоящих Правил клиринга, после получения данных из Расчетной организации. Сравнение производится только для отрицательных значений регистров Обязательств.

5.3.5. В том случае, когда модули значений Нетто-обязательств Участников клиринга по денежным средствам не превышают значения Клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах на торговых банковских счетах Участников клиринга, все договоры Участника клиринга считаются обеспеченными денежными средствами.

5.3.6. Для договора поставки товара Клиринговая организация проверяет обеспеченность договора денежными средствами путем сравнения раздела регистра, указанного в п. 8.3.9 настоящих Правил клиринга (для собственных договоров Участника клиринга) или в п. 8.3.10 настоящих Правил клиринга (для договоров, заключенных за счет клиентов Участника клиринга), для обеспечения конкретного Договора поставки товара с разделом регистра учета обязательств по указанному конкретному Договору поставки товара. Договор считается обеспеченным, когда сумма на разделе для учета обеспечения по Договору поставки товара равна обязательству (или больше обязательства) по этому Договору поставки товара.

5.4. Порядок и условия исключения Обязательств из клирингового пула

5.4.1. В том случае, когда при проверке обеспеченности Обязательств (кроме Обязательств с Биржевым товаром), включенных в Клиринговый пул, модули значений Нетто-обязательств Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам превышают значения Клиринговых регистров, содержащих информацию о свободных денежных средствах и ценных бумагах Участников клиринга, Клиринговая организация осуществляет исключение необеспеченных Обязательств из Клирингового пула.

5.4.2. При проведении клиринга в отношении обязательств из договоров, заключенных в Секции МКР, с кодом расчетов Вп, Клиринговая организация исключает Обязательства из Клирингового пула таким образом, чтобы в результате

был исполнен максимально возможный объем Обязательств всех Участников клиринга. В случае, если критерий максимальности исполнения Обязательств не позволяет однозначно определить исключаемые Обязательства (т.е. максимального исполнения можно добиться, исключая или одни, или другие Обязательства) в первую очередь исключаются Обязательства из договоров, заключенных в более позднее время. Время заключения договора определяется по данным из реестра договоров Биржи, в том числе по номеру договора, присвоенному Биржей.

5.4.3. При проведении клиринга в отношении Обязательств с кодом расчетов Вп из договоров, заключенных в Фондовой секции, Клиринговая организация исключает из Клирингового пула первую очередь Обязательства из договоров, заключенных в более позднее время. Время заключения договора определяется по данным из реестра договоров Биржи, в том числе по номеру договора, присвоенному Биржей.

5.4.4. В случае выявления недостатка обеспечения по кредитным договорам у Участника клиринга, выступающего в качестве заемщика, из Клирингового пула исключаются все Обязательства данного Участника клиринга. Исполнение Обязательств в этом случае осуществляется в соответствии с правилами, установленными Генеральными соглашениями для соответствующих договоров.

5.4.5. В случае недостатка обеспечения по депозитным договорам у Участника клиринга категории «В», из Клирингового пула исключаются все Обязательства по договорам данного Участника клиринга в отношении тех Участников клиринга категории «Б», которые имеют Нетто-требования (положительное значение НО, вычисленного в соответствии с п.5.2.2 настоящих Правил клиринга) в отношении указанного Участника клиринга категории «В».

5.4.6. В случае недостатка обеспечения по депозитным договорам у Участника клиринга категории «Б», из Клирингового пула исключаются все Обязательства по договорам указанного Участника клиринга с Участником клиринга категории «В», в отношении которого выявлен недостаток обеспечения.

5.4.7. В случае недостатка обеспечения по договорам в Секции МКР, кроме случаев, указанных в п.5.4.4 п.5.4.5 и п. 5.4.6 настоящих Правил клиринга, из Клирингового пула исключаются Обязательства в соответствии с п. 5.4.2 настоящих Правил клиринга.

5.4.8. После проведения описанных в настоящем подразделе действий по исключению Обязательств из Клирингового пула Клиринговая организация направляет распоряжения в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий для проведения расчетов, после чего необеспеченные Обязательства из договоров в Секции МКР включаются в следующий Клиринговый пул, окончание проведения таких действий определяется регламентом проведения расчетов.

5.4.9. При проведении контроля значений Клиринговых регистров Клиринговая организация осуществляет сверку значений торговых позиций Участников клиринга в системе торгов на момент формирования Реестра договоров, по которым производится Клиринг, с соответствующими значениями Клиринговых регистров, содержащих информацию о значениях остатков на торговых счетах Участников клиринга и счетах внутреннего учета средств

Участников клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ с учетом исполнения их Нетто-обязательств и Нетто-требований.

5.4.10. В том случае, если в результате сверки обнаружены расхождения, Клиринговая организация выполняет действия по согласованию результатов расчетов согласно п.5.7 настоящих Правил клиринга.

5.4.11. Если денежные средства для обеспечения исполнения по определенному Договору поставки товара не поступили в полном объеме (с учетом заблокированного ранее начального Гарантийного обеспечения, определенного п.6.1.9 настоящих Правил клиринга) на Клиринговый счет АО СПВБ, Клиринговая организация фиксирует недостаток обеспечения по указанному Договору поставки товара и исключает указанный Договор поставки товара из Клирингового пула.

5.4.12. Если по Договору поставки товара, исключенному из Клирингового пула, не наступила Дата обеспечения, указанный Договор поставки товара включается в Клиринговый пул, формируемый в следующей клиринговой сессии. Неттинг по Договорам поставки товара не проводится.

5.5. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по итогам клиринга (кроме обязательств из Договоров поставки товара)

5.5.1. Расчеты по Нетто-обязательствам и Нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам осуществляет Расчетная организация на основании Распоряжений на проведение операций, полученных от Клиринговой организации.

5.5.2. Расчеты по Нетто-обязательствам и Нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам осуществляет Расчетный депозитарий на основании Распоряжений на проведение операций, полученных от Клиринговой организации.

5.5.3. Все распоряжения на операции по итогам проведения Клиринга формируются Клиринговой организацией на основании полученных от Биржи Реестров договоров по итогам торгов, без дополнительного подтверждения договоров со стороны Участников клиринга.

5.5.4. На основании значений Клиринговых регистров, перечисленных в подразделах 8.2 и 8.4 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация формирует и передает:

5.5.4.1. в Расчетный депозитарий – Распоряжение на проведение операций по торговым счетам депо, по Разделу «к размещению/выкупу», являющиеся основаниями для проведения операций по торговым счетам депо Участников клиринга, по Разделу «к размещению/выкупу». Распоряжения передаются в Расчетный депозитарий, в котором открыты торговые счета, Раздел «к размещению/выкупу» на Специальном техническом счете для учета ценных бумаг;

5.5.4.2. в Расчетную организацию – Распоряжение на проведение операций, являющееся основанием для проведения операций по торговым банковским счетам Участников клиринга и Клиринговым счетам АО СПВБ. Распоряжение передается в Расчетную организацию, в которой открыты торговые счета, для учета денежных средств.

5.5.5. Распоряжения, указанные в п.5.5.4, 5.5.12 и 5.5.13 настоящих Правил клиринга, передаются в форме электронных документов. Реквизиты указанных документов, форматы и способы передачи перечисленных документов устанавливаются договорами АО СПВБ с Расчетным депозитарием и Расчетной организацией.

5.5.6. На основании полученных от Клиринговой организации Распоряжений Расчетный депозитарий и полученных от Клиринговой организации Распоряжений Расчетная организация осуществляют переводы ценных бумаг и денежных средств по торговым счетам Участников клиринга, по Разделу «к размещению/выкупу» соответственно. Время осуществления операций определяется договорами Клиринговой организации с Расчетной организацией и Расчетным депозитарием.

5.5.7. При проведении расчетов по итогам клиринга Расчетная организация проводит списание денежных средств в рублях Российской Федерации с торговых банковских счетов Участников клиринга (за исключением Участников клиринга категории «В») в размере их Нетто-обязательств на клиринговый банковский счет АО СПВБ.

5.5.8. При проведении расчетов по итогам клиринга Расчетная организация проводит зачисление денежных средств в рублях Российской Федерации на торговые банковские счета Участников клиринга в размере их Нетто-требований с Клирингового банковского счета АО СПВБ (за исключением Участников клиринга категории «В»).

5.5.9. При проведении расчетов по депозитным договорам Клиринговая организация во внутреннем учете по Клиринговому счету проводит списание денежных средств Участников клиринга категории «В» в размере их Нетто-обязательств и зачисление в размере их Нетто-требований.

5.5.10. Расчетный депозитарий на основании Распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо осуществляет списание ценных бумаг с торговых счетов депо Участников клиринга, имеющих Нетто-обязательства по ценным бумагам, и их зачисление на торговые счета депо Участников клиринга, имеющих Нетто-требования по ценным бумагам в день исполнения Обязательств.

5.5.11. Расчетный депозитарий осуществляет переводы по торговым счетам депо Участников клиринга в корреспонденции со Специальным техническим счетом, не предназначенным для учета прав на ценные бумаги. Указанный Специальный технический счет используется Расчетным депозитарием для обеспечения процедуры поставки ценных бумаг в соответствии с Распоряжением Клиринговой организации, содержащим Нетто-обязательства и Нетто-требования Участников клиринга. Операции по такому техническому счету производятся на основании Распоряжения Клиринговой организации. После исполнения Обязательств по итогам Клиринга остаток ценных бумаг на указанном счете не допускается. Наименование, обозначение и режим указанного счета определяется Условиями осуществления депозитарной деятельности данного Расчетного депозитария в соответствии с законодательством Российской

Федерации, договором между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием и иными внутренними документами Клиринговой организации.

5.5.12. В течение одного дня возможно проведение нескольких размещений ценных бумаг. При проведении размещения ценных бумаг Расчетный депозитарий на основании Поручения Клиринговой организации на зачисление размещаемых ценных бумаг и получения необходимых отчетов от вышестоящего депозитария зачисляет размещаемые ценные бумаги на Раздел «к размещению/выкупу» Специального технического счета. Далее Расчетный депозитарий на основании Распоряжения на проведение операций по разделу «к размещению/выкупу» осуществляет списание ценных бумаг в размере Нетто-обязательств с Раздела «к размещению/выкупу» и их зачисление на торговые счета депо Участников клиринга, имеющих Нетто-требования по ценным бумагам по договорам с кодом расчетов «Вп» в день исполнения Обязательств по размещению ценных бумаг. Если после исполнения вышеуказанного Распоряжения на Разделе «к размещению/выкупу» остались неразмещенные ценные бумаги, то Расчетный депозитарий, на основании Поручения Клиринговой организации на списание неразмещенных ценных бумаг с Раздела «к размещению/выкупу», подает в вышестоящий депозитарий Поручение на списание неразмещенных ценных бумаг со своего счета депо номинального держателя на эмиссионный счет эмитента. Эмитент подает встречное Поручение на зачисление неразмещенных ценных бумаг на свой эмиссионный счет. После исполнения вышестоящим депозитарием операции по зачислению ценных бумаг на эмиссионный счет эмитента Расчетный депозитарий передает Клиринговой организации Отчет об исполнении поручения на списание неразмещенных ценных бумаг с Раздела «к размещению/выкупу». Не допускается наличие остатка ценных бумаг на Разделе «к размещению/выкупу» после проведения всех операций.

5.5.13. При проведении выкупа ценных бумаг эмитентом Расчетный депозитарий, на основании Распоряжения Клиринговой организации, осуществляет списание ценных бумаг в размере Нетто-обязательств с торговых счетов депо Участников клиринга и их зачисление на Раздел «к размещению/выкупу» Специального технического счета, по договорам с кодом расчетов «Вп» в день исполнения обязательств по выкупу ценных бумаг. После исполнения вышеуказанного Распоряжения Расчетный депозитарий, на основании Поручения Клиринговой организации на списание выкупленных ценных бумаг с Раздела «к размещению/выкупу» подает Поручение в вышестоящий депозитарий на списание выкупленного количества ценных бумаг со своего счета депо номинального держателя на казначейский счет эмитента. Эмитент подает встречное Поручение на зачисление выкупленных ценных бумаг на свой казначейский счет. После исполнения вышестоящим депозитарием операции списания Расчетный депозитарий передает Клиринговой организации Отчет об исполнении Поручения на списание выкупленных ценных бумаг с Раздела «к размещению/выкупу». После проведения всех операций остаток на разделе «к размещению/выкупу» не допускается.

5.5.14. Расчетная организация и Расчетный депозитарий передают Клиринговой организации информацию о денежных средствах и ценных бумагах на торговых счетах Участников клиринга, на Разделе «к размещению/выкупу»,

Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

сформированную по итогам обработки Распоряжений, указанных в п.5.5.4 настоящих Правил клиринга, в виде Отчета об остатках на торговых счетах Участников клиринга, остатка на Разделе «к размещению/выкупу». Время, порядок обмена электронными документами определяется договорами между Клиринговой организацией и Расчетной организацией, Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием.

5.5.15. Для депозитного договора Генеральным соглашением может быть предусмотрена возможность для Инициатора торгов отказаться от исполнения договора до проведения расчетов по размещению депозита. В этом случае Обязательства по указанному договору могут быть прекращены путем расторжения договора, заключенного на условиях Генерального соглашения. При получении Клиринговой организацией от Инициатора торгов Уведомления о расторжении договора, Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры сведения о прекращении Обязательств Участников клиринга по указанному договору.

5.6. Порядок проведения сверки результатов расчетов

5.6.1. Клиринговая организация на основании полученных из Расчетного депозитария и Расчетной организации Отчета об остатках ценных бумаг на торговых счетах депо, на Разделе «к размещению/выкупу» и Отчета об остатках денежных средств на торговых банковских счетах, сформированных по итогам обработки Распоряжения на проведение операций по разделам торговых счетов депо, по Разделу «к размещению/выкупу» и Распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, соответственно, присваивает значения Клиринговым регистрам, перечисленным в пп.8.1.1 – 8.1.11, 8.3.1, 8.3.4 настоящих Правил клиринга.

5.6.2. В Клиринговой системе проводится сверка значений соответствующих Клиринговых регистров, указанных в п.5.6.1 настоящих Правил клиринга, с данными, полученными в результате расчетов Клиринговой системы на основании предыдущих значений указанных Регистров и Регистров обязательств, по каждому Участнику клиринга.

5.6.3. При отсутствии расхождений Клиринговая организация направляет в Расчетную организацию, в Расчетный депозитарий Уведомления о завершении расчетов.

5.6.4. С момента направления Уведомлений о завершении расчетов, расчеты по Нетто-обязательствам и Нетто-требованиям Участников клиринга считаются выполненными, Обязательства Участников клиринга по договорам Клирингового пула считаются исполненными.

5.6.5. Порядок взаимодействия, время начала и сроки исполнения операций, проведения сверки значений соответствующих Клиринговых регистров определяются договорами Клиринговой организации с Расчетной организацией и с Расчетным депозитарием.

5.7. Порядок действий в случае расхождения данных при сверке

5.7.1. В случае обнаружения расхождений при проведении сверки значений соответствующих Клиринговых регистров с данными, полученными в результате собственных расчетов, по каждому Участнику клиринга Клиринговая организация формирует протокол расхождения данных при проведении сверки и направляет его в Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий для установления причин расхождения данных. Сроки выявления расхождений определяется договором, заключаемым Клиринговой организацией с Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием.

5.7.2. Клиринговая организация, Расчетная организация и/или Расчетный депозитарий, руководствуясь собственными внутренними процедурами, предпринимают действия по поиску и выявлению причин, приведших к расхождению данных, и их устранению.

5.7.3. В зависимости от характера выявленных причин расхождения данных Клиринговая организация, Расчетная организация или Расчетный депозитарий повторно выполняют действия, описанные в подразделе 5.5 настоящих Правил клиринга и Договорах о взаимодействии между Клиринговой организацией и Расчетной организацией, между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием.

5.8. Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением

5.8.1. В случае введения процедуры банкротства в отношении Участника клиринга или отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации все Обязательства этого Участника клиринга, допущенные к Клирингу, прекращаются путем ликвидационного Неттинга, установленным настоящим подразделом. Клиринговая организация рассчитывает денежные Обязательства / Требования, возникающие в связи проведением ликвидационного Неттинга (далее в настоящем подразделе – ликвидационные Нетто-обязательства/Нетто-требования).

5.8.2. Обязательства/Требования Участника клиринга – кредитной организации прекращаются возникновением ликвидационных Нетто-обязательств /Нетто-требований на дату, следующую за датой отзыва у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций. Обязательства/Требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, прекращаются возникновением ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований на дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства.

5.8.3. Клиринговая организация рассчитывает ликвидационные Нетто-обязательства/Нетто-требования Участника клиринга, возникающие взамен прекращенных в соответствии с п.5.8.1 настоящих Правил клиринга, в отношении каждого иного Участника клиринга, перед которым указанный Участник клиринга имеет Обязательства или к которому указанный Участник клиринга имеет Требования (далее - контрагент), отдельно по следующим договорам:

5.8.3.1. заключенным Участником клиринга за свой счет,
 5.8.3.2. заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов,

5.8.3.3. заключенным Участником клиринга, за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

5.8.4. Ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование рассчитывается в рублях Российской Федерации и не включает в себя возмещение убытков в форме упущенной выгоды и взыскание неустоек (штрафов, пеней).

5.8.5. Ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование рассчитывается по следующей формуле:

$$НО = \sum_i (RT_i - RO_i) + \sum_{k,l} (S_k T_l - S_k O_l) * C_{kl},$$

где НО – ликвидационное Нетто-обязательство / Нетто-требование в отношении соответствующего контрагента по договорам соответствующего вида, указанного в п.5.8.3 настоящих Правил клиринга,

RT_i - денежное (в рублях) Требование Участника клиринга по i -тому договору на дату признания Участника клиринга банкротом / отзыва лицензии на осуществление банковских операций;

RO_i - денежное (в рублях) Обязательство Участника клиринга по i -тому договору на дату признания Участника клиринга банкротом / отзыва лицензии на осуществление банковских операций;

при определении RT_i и RO_i учитываются все денежные Обязательства, выраженные в рублях Российской Федерации, по договорам соответствующего вида во всех секциях Биржи;

при наличии Обязательств/Требований по возврату средств по депозитным/кредитным договорам у Участника клиринга или контрагента до даты признания Участника клиринга банкротом / даты отзыва лицензии (не включая указанные даты);

при наличии Обязательств/Требований по Договорам поставки товара при определении RT_i и RO_i учитываются Обязательства и требования по i -тому Договору поставки товара в размере стоимости фактически поставленного объема товара, при расчете стоимости поставленного товара используется цена товара, указанная в соответствующем Договоре поставки товара;

$S_k T_l$ и $S_k O_l$ - Требование и Обязательство по k -той ценной бумаге по l -тому договору с этой ценной бумагой;

C_{kl} – цена k -той ценной бумаге по l -тому договору, принимаемая равной рыночной цене ценной бумаги на день предшествующий дню расчета ликвидационных Нетто-обязательств. Рыночная цена определяется согласно Правилам организованных торгов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа». Если рыночная цена ценной бумаги не определялась, значение C_{kl} принимается равным расчетной цене ценной бумаги, определенной в соответствии с Налоговым кодексом Российской Федерации.

Отрицательное значение НО означает Нетто-обязательство Участника клиринга, положительное значение НО – Нетто-требование Участника клиринга.

5.8.6. Клиринговая организация направляет Участнику клиринга и его контрагентам Уведомление о прекращении Обязательств/Требований по договорам, допущенным к Клирингу, и рассчитанных в соответствии с п.5.8.5

настоящих Правил клиринга размерах ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований в дату расчета.

5.8.7. Денежные средства и иное имущество Участника клиринга, находящиеся на торговых и Клиринговых счетах после расчета ликвидационных Нетто-обязательств / Нетто-требований, подлежат возврату Участнику клиринга, в том числе для включения в конкурсную массу. В этом случае Клиринговая организация запрашивает у Участника клиринга либо его правопреемника (представителя) реквизиты счетов для перечисления денежных средств и иного имущества не позднее рабочего дня, следующего за днем расчета ликвидационных Нетто-обязательств. Возврат денежных средств и иного имущества осуществляется в течение 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг.

5.8.8. Денежные средства и иное имущество клиентов Участника клиринга, зарегистрированных в Клиринговой системе, могут быть переданы клиентам Участника клиринга или другим Участникам клиринга в порядке, установленном законодательством Российской Федерации.

5.9. Порядок проведения клиринга и исполнения обязательств по договорам с Биржевым товаром (Договорам поставки товара)

5.9.1. В день получения Реестра договоров от Биржи в отношении Договоров поставки товара Клиринговая организация открывает во внутреннем учете разделы регистра, указанного в п.8.3.9 или п.8.3.10 настоящих Правил клиринга, для учета обеспечения по каждому Договору поставки товара и зачисляет на указанный раздел сумму в размере Гарантийного обеспечения Договора поставки товара в соответствии с разделом 6 настоящих Правил клиринга.

5.9.2. На следующий рабочий день после получения Реестра договоров от Биржи в отношении договоров с Биржевым товаром Клиринговая организация включает Обязательства по указанным сделкам в Клиринговый пул и проводит контроль обеспечения согласно п.5.3.6 настоящих Правил клиринга.

5.9.3. В отношении Договоров поставки товара, прошедших контроль обеспечения денежными средствами, Клиринговая организация направляет Участнику клиринга – Поставщику Запрос о готовности товара к поставке, если в соответствии с Внутренними документами Биржи установлена обязанность Покупателя совершить действия, необходимые для поставки Биржевого товара (предоставление реквизитных заявок, маршрутных телеграмм, оплата транспортных расходов и т.п.) или если Участник клиринга – Поставщик принадлежит к категории «К».

5.9.4. В случае получения от Участника клиринга категории «К» Уведомления о готовности к поставке по Договору поставки товара, Клиринговая организация списывает денежные средства в размере Обязательства по Договору поставки товара с открытого для обеспечения исполнения указанного Договора поставки товара раздела Регистра Участника клиринга – Покупателя, зачисляет на Регистр свободных от обязательств средств Участника клиринга категории «К», являющегося Поставщиком по данному Договору поставки товара, и списывает с

Клирингового счета указанные средства в пользу Поставщика, используя для перечисления банковские реквизиты, указанные в его Анкете Участника клиринга.

5.9.5. Участник клиринга категории «К», денежные обязательства по Договору поставки товара перед которым исполнены, обязан в течение 4 (четырёх) рабочих дней с Даты завершения поставки предоставить Клиринговой организации Отчет о завершении поставки (при необходимости с уведомлением о стороне, из-за действия (бездействия) которой поставка не была завершена в Дату завершения поставки).

5.9.6. Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, обязан до Даты завершения поставки предоставить подтверждение готовности к поставке в соответствии с Запросом, определенном п.5.9.3 настоящих Правил клиринга, или уведомить Клиринговую организацию о неготовности к поставке на Дату завершения поставки. В последнем случае Клиринговая организация исключает обязательства из договора из Клирингового пула и ожидает от Поставщика и Покупателя действий согласно п.5.9.17 и п.5.9.18 настоящих Правил клиринга или разрешения спора по договору в судебном порядке.

5.9.7. Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, в течение 4 (четырёх) рабочих дней с Даты завершения поставки обязан предоставить документы, свидетельствующие об осуществлении поставки (акт), а Участник клиринга, являющийся Покупателем, в течение 2 (двух) рабочих дней с момента получения документов (акта), должен подтвердить отсутствие возражений по предоставленным документам. При получении подтверждения поставки в соответствии с настоящим пунктом, Клиринговая организация списывает денежные средства в размере Обязательства по Договору поставки товара с открытого для обеспечения исполнения указанного Договора поставки товара раздела регистра Участника клиринга – Покупателя, зачисляет на регистр свободных от обязательств средств Участника клиринга категории «Т», являющегося Поставщиком по данному Договору поставки товара. Для получения денежных средств на свой счет в банке Участник клиринга категории «Т», являющийся Поставщиком, передает Клиринговой организации Распоряжение на отзыв денежных средств.

5.9.8. После получения документов, определенных п.5.9.5 или п.5.9.7 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры информацию о прекращении обязательств по Договору поставки товара.

5.9.9. В случае если на Дату обеспечения Договор поставки товара не прошел контроль обеспечения и исключен из Клирингового пула, Клиринговая организация списывает Неустойку по Договору поставки товара в размере суммы Гарантийного обеспечения, зачисленного в дату заключения договора, на Регистр, предназначенный для учета обеспечения по такому Договору поставки товара не прошедшего контроль обеспечения, открытого Участнику клиринга – Покупателю, и зачисляет Неустойку по этому Договору поставки товара на Регистр свободных денежных средств Участника клиринга – Поставщика.

5.9.10. В случае нарушения Участником клиринга категории «К» обязанностей, предусмотренных п.5.9.5 настоящих Правил клиринга, или получения в соответствии с п.5.9.5 настоящих Правил клиринга Уведомления о *Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»*

нарушении Участником клиринга категории «К» Обязательств по поставке Биржевого товара Клиринговая организация направляет Уведомление о необходимости возврата суммы оплаты по Договору поставки товара. При этом Клиринговая организация перечисляет в оплату неустойки по договору поставки денежные средства в размере, определенном в соответствии со Спецификацией биржевого товара, с регистра учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга категории «К» в адрес Покупателя по договору поставки. Участник клиринга категории «К» обязан зачислить на Клиринговый счет АО СПВБ денежные средства в размере полученной оплаты по указанному Договору поставки товара в соответствии с условиями Договора поставки товара. Не позднее следующего рабочего дня со дня зачисления указанных денежных средств Клиринговая организация перечисляет поступившие средства контрагенту Участника клиринга категории «К» по Договору поставки товара.

5.9.11. В случае недостатка денежных средств, учитываемых на регистре учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга категории «К», для полной оплаты неустойки, Клиринговая организация направляет такому Участнику клиринга Уведомление о необходимости оплаты Неустойки. Участник клиринга категории «К» обязан зачислить на Клиринговый счет АО СПВБ денежные средства в размере требования по оплате Неустойки, указанного в Уведомлении о необходимости оплаты Неустойки.

5.9.12. В случае невозврата суммы оплаты по Договору поставки товара в установленный срок и/ или неоплаты Неустойки Клиринговая организация приостанавливает допуск такого Участника к клиринговому обслуживанию с категорией «К» и осуществляет клиринговое обслуживание такого Участника клиринга с категорией «Т».

5.9.13. В случае использования Гарантийного обеспечения Участника клиринга категории «К» в оплату Неустойки, такой Участник клиринга обязан пополнить свое Гарантийное обеспечение до суммы, указанной в пункте 3.2.4.3 до начала следующей торговой сессии.

5.9.14. В случае нарушения Участником клиринга категории «Т», являющимся Поставщиком, требований установленных п.5.9.7 настоящих Правил клиринга, при условии, что указанный Участник клиринга уведомлял Клиринговую организацию о готовности к поставке по Договору поставки товара, Клиринговая организация списывает Неустойку по Договору поставки товара в размере, определенном в соответствии со Спецификацией биржевого товара, с раздела Регистра для учета обеспечения по Договору поставки товара, в отношении которого нарушены требования п.5.9.7 настоящих Правил клиринга, и зачисляет их на Регистр свободных денежных средств Участника клиринга – Покупателя.

5.9.15. Оплата Неустойки по Договору поставки товара в соответствии с настоящим подразделом Правил клиринга прекращает обязательства по Договору поставки товара, учитываемые Клиринговой организацией. После оплаты Неустойки по Договору поставки товара Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры информацию о прекращении Обязательств из Договора поставки товара способом отличным от исполнения (путем уплаты неустойки).

5.9.16. Участники клиринга, выступающие Продавцом и Покупателем по Договору поставки товара, могут проинформировать Клиринговую организацию о внесении изменений в существенные условия Договора поставки товара путем направления в Клиринговую организацию от обеих сторон Договора поставки товара Уведомления об изменении существенных условий договора. В этом случае Клиринговая организация вносит изменения в Клиринговые регистры, если изменились Дата обеспечения или Дата поставки товара или размер обязательств, и осуществляет Клиринг в соответствии с новыми параметрами Договора поставки товара.

5.9.17. Продавец и Покупатель информируют Клиринговую организацию о прекращении обязательств по Договору поставки товара по соглашению сторон путем направления в Клиринговую организацию Уведомления о прекращении обязательств по соглашению Сторон. Информация о прекращении обязательств из Договора поставки товара в обязательном порядке должна включать указание, какой из сторон перечисляется с Клирингового счета АО СПВБ Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Обязательств, по указанному Договору поставки товара на счете внутреннего учета Продавца и на счете внутреннего учета Покупателя. Клиринговая организация вносит в Клиринговые регистры информацию о прекращении Обязательств из Договора поставки товара способом отличным от исполнения и перечисляет денежные средства, которые были заблокированы для обеспечения исполнения или исполнения указанного Договора поставки товара, Участникам клиринга в соответствии с полученным указанием. Прекращение Обязательств по соглашению сторон невозможно в случае получения такого соглашения после штатного исполнения обязательств по Договору поставки товара или после прекращения обязательств по этому Договору поставки путем уплаты неустойки.

6. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу

6.1. Индивидуальное клиринговое обеспечение

6.1.1. Индивидуальным клиринговым обеспечением является Гарантийное обеспечение.

6.1.2. Гарантийное обеспечение принимается в виде денежных средств и/или ценных бумаг. Для Договоров поставки товара Гарантийное обеспечение принимается только в российских рублях.

6.1.3. Гарантийное обеспечение учитывается на соответствующих торговых счетах Участника клиринга, Гарантийное обеспечение Участника клиринга категорий «В», «Т» и «К» учитывается на Клиринговом счете АО СПВБ, во внутреннем учете Клиринговой организацией на регистре (счете) для учета Гарантийного обеспечения Участника клиринга, предоставившего Гарантийное обеспечение.

6.1.4. Порядок использования Гарантийного обеспечения регулируется настоящими Правилами клиринга. Подписание отдельного соглашения о Гарантийном обеспечении не требуется.

6.1.5. При заключении договоров (кроме Договоров поставки товара) Участником клиринга в Клиринговые регистры, указанные в пп. 8.3.3, 8.3.6 настоящих Правил клиринга, вносятся сведения о суммах заблокированного Гарантийного обеспечения. При заключении Договоров поставки товара на Клиринговых регистрах, указанных в п.8.3.9, 8.3.10 настоящих Правил клиринга, открываются разделы для отдельного учета Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара, заключенного Участником клиринга, куда вносятся сведения о заблокированных суммах Гарантийного обеспечения. В случае заключения договоров на основании Генерального соглашения величина Гарантийного обеспечения или порядок ее определения устанавливаются Генеральным соглашением. Величина Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара определяется в соответствии с п.6.1.8 настоящих Правил клиринга.

6.1.6. В случае, если на дату исполнения обязательств обеспечения по договору недостаточно (кроме Договоров поставки товара, договоров, заключенных при размещении ОФЗ и/или ОБР) из-за отсутствия денежных средств или ценных бумаг на торговых счетах одного из Участников клиринга при том, что Участник клиринга, являющийся другой стороной по договору, полностью исполнил свои Обязательства, Обязательства прекращаются путем уплаты Неустойки в размере Гарантийного обеспечения Участником клиринга, имеющего необеспеченные Обязательства, Участнику клиринга, выступающему второй стороной по договору.

6.1.7. В случае если по Договору поставки товара требуется уплатить Неустойку по Договору поставки товара согласно подразделу 5.9 настоящих Правил клиринга, для уплаты используются только средства Гарантийного обеспечения, учтенные на разделе регистра Участника клиринга, нарушившего обязательства, предназначенном для учета Гарантийного обеспечения по конкретному Договору поставки товара.

6.1.8. Величина Гарантийного обеспечения (Гарантийного обеспечения необходимого на дату заключения договора с Биржевым товаром) для обеспечения Договора поставки товара определяется в соответствии со Спецификацией биржевого товара. Величина Гарантийного обеспечения на Дату обеспечения и позже устанавливается равной сумме Договора поставки товара.

6.1.9. Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Договора поставки товара со стороны Участника клиринга – Покупателя, используется для исполнения Обязательств по этому Договору поставки товара.

6.1.10. Гарантийное обеспечение, заблокированное для обеспечения исполнения Договора поставки товара со стороны Участника клиринга – Поставщика, разблокируется после внесения в Клиринговые регистры информации о прекращении Обязательств по указанному Договору поставки товара и переводится на регистр «Денежные средства ГО Участника клиринга - товарный рынок - свободные», регистр «Денежные средства Участника клиринга - товарный рынок - заблокированные для исполнения» закрывается.

7. Виды торговых и клиринговых счетов и порядок совершения операций по ним

7.1. Виды торговых и клиринговых счетов

7.1.1. В соответствии с договором, заключенным с Участником клиринга, Расчетная организация для учета денежных средств и проведения расчетов по итогам клиринга открывает Участнику клиринга следующие торговые банковские счета:

7.1.1.1. счет собственных средств;

7.1.1.2. специальный брокерский счет (Участнику клиринга – профессиональному участнику рынка ценных бумаг);

7.1.1.3. специальный торговый счет (Участнику клиринга – кредитной организации);

7.1.1.4. отдельный специальный торговый счет (Участнику клиринга – для учета обеспечения клиента, зарегистрированного в клиринговой организации).

7.1.2. клиентам Участника клиринга могут быть открыты в Расчетной организации торговые банковские счета для учета собственных средств. В этом случае Клиринговая организация осуществляет операции по таким счетам на основании Обязательств Участника клиринга по договорам, заключенным за счет и по поручению таких клиентов. В дальнейшем, под торговым банковским счетом Участника клиринга понимается также соответствующий торговый банковский счет клиента Участника клиринга.

7.1.3. На счете собственных средств учитываются средства Участника клиринга, предназначенные для оплаты вознаграждения АО СПВБ, Расчетной организации и Расчетному депозитарию, для исполнения обязательств и обеспечения исполнения Обязательств по договорам, заключенным Участником клиринга за свой счет.

7.1.4. На специальном брокерском счете учитываются средства клиентов Участника клиринга, предназначенные для оплаты вознаграждения АО СПВБ, Расчетной организации и Расчетному депозитарию, исполнения обязательств и обеспечения исполнения Обязательств по договорам, заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов.

7.1.5. На специальном торговом счете учитываются средства клиентов Участника клиринга – кредитной организации, предназначенные для оплаты вознаграждения АО СПВБ, Расчетной организации и Расчетному депозитарию, исполнения Обязательств и обеспечения исполнения Обязательств по договорам, заключенным Участником клиринга за счет своих клиентов.

7.1.6. В соответствии с договором, заключенным с Клиринговой организацией, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения операций с ценными бумагами по результатам договоров, заключенных при размещении ценных бумаг, использует раздел Специального технического счета «для размещения/выкупа».

7.1.7. В соответствии с договором, заключенным с Участником клиринга или Держателем, Расчетный депозитарий для учета ценных бумаг и проведения

операций с ценными бумагами по результатам заключенных договоров открывает Участнику клиринга или Держателю торговые счета депо.

7.1.8. На торговых счетах депо учитываются ценные бумаги, которые могут быть использованы для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу.

7.1.9. Торговые счета депо подразделяются на:

7.1.9.1. торговый счет депо владельца, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

7.1.9.2. торговый счет депо номинального держателя, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

7.1.9.3. торговый счет депо владельца с попечителем, открытый клиенту Участника клиринга, являющегося попечителем этого счета;

7.1.9.4. торговый счет депо доверительного управляющего, открытый Участнику клиринга для учета ценных бумаг, находящихся у Участника клиринга в доверительном управлении;

7.1.9.5. казначейский торговый счет депо, открытый эмитенту для приобретения или отчуждения ценных бумаг в процессе их обращения;

7.1.9.6. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве;

7.1.9.7. торговый счет депо номинального держателя, открытый Держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

7.1.9.8. торговый счет депо, открытый Держателю для учета ценных бумаг, находящихся у Участника клиринга в доверительном управлении;

7.1.9.9. торговый счет депо иностранного номинального держателя, открытый иностранному номинальному держателю для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга;

7.1.9.10. торговый счет депо иностранного уполномоченного держателя, открытый иностранному уполномоченному держателю, для учета ценных бумаг, переданных в управление иностранному уполномоченному держателю, обслуживаемому Участником клиринга.

7.1.10. В соответствии с договором между Клиринговой организацией и Расчетной организацией последняя открывает Клиринговой организации Клиринговые счета для учета денежных средств, которые используются для обеспечения и исполнения Обязательств, допущенных к Клирингу.

7.2. Порядок проведения операций по торговым банковским счетам

7.2.1. Операции по торговым банковским счетам производятся согласно распоряжениям Клиринговой организации в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга, или по распоряжению Участника клиринга с согласия Клиринговой организации, в порядке, установленном настоящим подразделом.

7.2.2. Денежные средства на торговые банковские счета для исполнения Обязательств и обеспечения исполнения Обязательств зачисляются в следующем порядке:

7.2.2.1. по распоряжению Участника клиринга с банковского (корреспондентского) счета Участника клиринга;

7.2.2.2. по распоряжению АО СПВБ с Клирингового счета АО СПВБ, в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга.

7.2.3. Денежные средства с торговых банковских счетов списываются в следующем порядке:

7.2.3.1. по распоряжению Клиринговой организации, по распоряжению Участника клиринга с согласия Клиринговой организации или по распоряжению Клиринговой организации на основании распоряжения Участника клиринга на банковский (корреспондентский) счета Участника клиринга;

7.2.3.2. по распоряжению АО СПВБ на Клиринговый счет АО СПВБ или (для комиссионного вознаграждения) на счет АО СПВБ в Расчетной организации, в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга.

7.2.4. На период проведения расчетов по итогам Клиринговой сессии Расчетная организация блокирует операции на торговых банковских счетах, производимые по распоряжению Участника клиринга. Блокировка означает, что списание и зачисление денежных средств по торговым банковским счетам Участника клиринга производится только на основании Распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, предусмотренного настоящими Правилами клиринга.

7.2.5. В период проведения Торговой сессии зачисление на торговые банковские счета Участника клиринга производится на основании согласия Клиринговой организации на зачисление, данного Расчетной организации в отношении всех торговых банковских счетов или группы торговых банковских счетов.

7.2.6. Списание денежных средств с торговых банковских счетов по Распоряжению Участника клиринга производится с согласия Клиринговой организации, получаемого Расчетной организацией в отношении каждой суммы по определенному торговому банковскому счету.

7.2.7. Клиринговая организация после получения запроса на списание денежных средств с торгового банковского счета Участника клиринга осуществляет проверку достаточности денежных средств на этом счете.

7.2.8. Сумма денежных средств на торговом банковском счете Участника клиринга, остающаяся после списания, должна обеспечивать исполнение Обязательств Участника клиринга по договорам, срок исполнения которых наступает в день получения запроса на списание после окончания текущей Клиринговой сессии, и необходимый уровень Гарантийного обеспечения для договоров, срок исполнения которых не наступает в день получения запроса на списание, исполнение Обязательств по которым производится с использованием торгового банковского счета, указанного в запросе.

7.2.9. При успешной проверки достаточности денежных средств Клиринговая организация направляет Расчетной организации подтверждение, на основании которого Расчетная организация производит списание денежных средств. Если результат проверки отрицательный, Клиринговая организация направляет Расчетной организации отказ в подтверждении, который служит основанием для отказа Расчетной организацией в исполнении платежного поручения Участника клиринга.

7.2.10. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Уведомления о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам, сформированного по окончании Клиринговой сессии в отношении свободного остатка денежных средств на торговых банковских счетах.

7.2.11. Списание денежных средств с торговых банковских счетов может производиться на основании Распоряжения на списание денежных средств, предоставленного Клиринговой организации Участником клиринга. Для этого Участник клиринга может оформить соответствующее Распоряжение по форме, предусмотренной Положением о формах и форматах документов Клиринговой организации.

7.2.12. Зачисление средств на торговые банковские счета и списание средств с торговых банковских счетов при исполнении Обязательств по итогам Клиринга производится на основании Распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга.

7.2.13. Участник клиринга, планирующий заключение на торгах договоров с кодом расчетов «Т0» по покупке ценных бумаг за счет собственных средств, должен внести в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения его Обязательств по денежным средствам с текущей датой исполнения, на торговом банковском счете для учета собственных средств.

7.2.14. Участник клиринга, планирующий заключение на торгах договоров с кодом расчетов «Т0» по покупке ценных бумаг в интересах клиентов, должен зарезервировать в полном объеме сумму денежных средств, необходимую для обеспечения исполнения Обязательств по денежным средствам на специальном брокерском или специальном торговом счете.

7.2.15. Участник клиринга, имеющий Нетто-обязательства по договорам, заключенным в Секции МКР с текущей датой исполнения должен обеспечить наличие денежных средств на торговом банковском счете в Расчетной организации или на Клиринговом счете АО СПВБ (для Участника клиринга категории «В») в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его Обязательств, в срок не позднее времени начала формирования соответствующего Клирингового пула.

7.2.16. Участник клиринга, имеющий Нетто-обязательства по денежным средствам по договорам с кодом расчетов «Вп», должен обеспечить наличие денежных средств на торговом банковском счете в Расчетной организации

в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его Обязательств, в срок не позднее времени начала формирования соответствующего клирингового пула.

7.3. Порядок проведения операций по торговым счетам депо и Специальному техническому счету

7.3.1. Открытие и закрытие торгового счета депо, в отношении которого получено указание о проведении операций по распоряжению или с согласия Клиринговой организации, производится Расчетным депозитарием с согласия Клиринговой организации. Порядок получения согласия Клиринговой организации на открытие торгового счета депо регулируется договором АО СПВБ с Расчетным депозитарием. Согласие Клиринговой организации на закрытие торгового счета депо направляется Расчетному депозитарию в ответ на запрос о возможности такого закрытия.

7.3.2. Ценные бумаги с торговых счетов депо списываются или зачисляются по Поручению Участника клиринга с согласия Клиринговой организации, за исключением зачисления или списания ценных бумаг при расчетах по итогам Клиринга.

7.3.3. Зачисление и списание ценных бумаг по торговым счетам депо, при исполнении Обязательств по итогам Клиринга, производится на основании Распоряжений на проведение операций по торговым счетам депо, в порядке, установленном подразделом 5.5 настоящих Правил клиринга, с использованием Специального технического счета. При размещении ценных бумаг зачисление размещенных ценных бумаг на торговые счета депо производится на основании Распоряжений Клиринговой организации с Раздела «к размещению/выкупу» Специального технического счета. При выкупе ценных бумаг списание ценных бумаг с торговых счетов депо производится на основании Распоряжений Клиринговой организации на Раздел «к размещению/выкупу» Специального технического счета.

7.3.4. Расчетный депозитарий исполняет Поручения Участника клиринга по торговым счетам депо после получения согласия Клиринговой организации на проведение этих операций.

7.3.5. Участник клиринга, планирующий заключение на текущих торгах договоров по продаже ценных бумаг с кодом расчетов «Т0», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его Обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо.

7.3.6. Участник клиринга, имеющий Нетто-обязательство по ценным бумагам по договорам с кодом расчетов «Вп», должен обеспечить наличие ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его Обязательств по ценным бумагам на соответствующем торговом счете депо.

7.3.7. Участник клиринга, имеющий Нетто-обязательство по ценным бумагам по договорам с кодом расчетов «Вп», заключенным при размещении ценных бумаг, должен обеспечить наличие размещаемых ценных бумаг в количестве, необходимом для обеспечения исполнения его Обязательств по ценным бумагам, в Расчетном депозитарии (на счете депо номинального держателя

Расчетного депозитария) для зачисления на Раздел «к размещению/выкупу» Специального технического счета в соответствии с пунктом 5.5.11 настоящих Правил клиринга.

7.3.8. В случае наложения ареста на ценные бумаги, учет прав на которые осуществляется на торговом счете депо, Расчетный депозитарий информирует о данном факте Клиринговую организацию. Уведомление должно быть направлено в день наложения ареста и содержать реквизиты торгового счета депо и ценных бумаг, учитываемых на этом счете, на которые наложен арест. Уведомление направляется по всем каналам связи, определенным договором между Расчетным депозитарием и Клиринговой организацией.

7.3.9. Клиринговая организация перечисляет арестованные ценные бумаги с регистра «Блокировано на торги» на регистр «Арестованные ценные бумаги» и информирует Биржу о необходимости уменьшения торговых позиций Участников торгов по указанным в Уведомлении ценным бумагам.

7.4. Порядок проведения операций по клиринговым счетам

7.4.1. Клиринговая организация при осуществлении Клиринговой деятельности использует Клиринговые банковские счета в рублях Российской Федерации. Клиринговая организация может открывать в Расчетной организации несколько Клиринговых счетов. Клиринговая организация ведет внутренний учет средств Участников клиринга и средств клиентов Участников клиринга на Клиринговом банковском счете.

7.4.2. Денежные средства на Клиринговом банковском счете, открытом в Расчетной организации, используются для обеспечения исполнения Обязательств Участников клиринга по денежным средствам. Участники клиринга категорий «В», «Т» и «К» зачисляют денежные средства на Клиринговый банковский счет самостоятельно, в установленное регламентом Расчетной организации время.

7.4.3. В период проведения расчетов по итогам Клиринга зачисление денежных средств на указанный счет осуществляется только по распоряжению Клиринговой организации с торговых банковских счетов Участников клиринга или других Клиринговых счетов АО СПВБ. Денежные средства зачисляются в размере Нетто-обязательств Участников клиринга по договорам, включенным в Клиринговый пул. Комиссионное вознаграждение в расчет Нетто-обязательства не включается.

7.4.4. В период проведения расчетов по итогам Клиринга списание денежных средств с указанного Клирингового банковского счета, открытого в Расчетной организации, осуществляется по распоряжениям Клиринговой организации в размере Нетто-требований Участников клиринга по договорам, включенным в Клиринговый пул.

7.4.5. До начала проведения расчетов по итогам Клиринга денежные средства на Клиринговый банковский счет в рублях Российской Федерации зачисляются с банковских (корреспондентских) счетов Участников клиринга категорий «В», «Т» и «К».

7.4.6. После проведения расчетов по итогам Клиринга свободные денежные средства Участника клиринга категории «В» списываются с Клирингового банковского счета на банковский (корреспондентский) счет Участника клиринга категории «В» на основании Распоряжения Участника клиринга категории «В». Распоряжение на списание средств должно содержать реквизиты счета Участника клиринга, на который должны быть переведены средства. Сумма денежных средств в Распоряжении не должна превышать суммы денежных средств на счете внутреннего учета средств Участника клиринга на Клиринговом счете, в случае превышения этой суммы, Участнику клиринга направляется отказ в исполнении Распоряжения.

7.4.7. Денежные средства Участников клиринга категорий «Т» и «К» списываются с Клирингового счета на банковские счета Участников клиринга указанных категорий после проведения операций по счетам внутреннего учета по итогам Клиринга Договоров поставки товара, в размере остатка денежных средств на счете внутреннего учета, полученных по итогам исполнения обязательств по Договорам поставки товара. По каждому оплаченному Договору поставки товара сумма оплаты перечисляется с Клирингового счета АО СПВБ отдельным платежом. Иные средства Участника клиринга, находящиеся на Клиринговом счете АО СПВБ перечисляются Участнику клиринга по его Распоряжению. В последнем случае сумма денежных средств в размере не более свободного остатка списывается с Клирингового счета АО СПВБ на банковский счет Участника клиринга после получения Распоряжения об отзыве средств.

7.4.8. В период проведения расчетов по итогам Клиринга зачисление денежных средств на указанный счет осуществляется только по распоряжению Клиринговой организации с торговых банковских счетов Участников клиринга.

8. Клиринговые регистры и иные формы внутреннего учета, их назначение, порядок ведения

8.1. Клиринговые регистры учета ценных бумаг

8.1.1. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – свои» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, на торговом счете депо в Расчетном депозитарии.

8.1.2. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – клиенты» – Клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, на торговом счете депо номинального держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.3. Регистр «Ценные бумаги клиента с попечителем Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг на торговом счете лица, имеющего попечителя этого счета – Участника клиринга, в Расчетном депозитарии.

8.1.4. Регистр «Ценные бумаги Участника клиринга – ДУ» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга на торговом счете депо в Расчетном депозитарии.

8.1.5. Регистр «Ценные бумаги для размещения/выкупа» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг для размещения/выкупа. Регистр соответствует Разделу «к размещению/выкупу», выделенному на Специальном техническом счете, не предназначенном для учета прав на ценные бумаги, который используется для проведения операций при размещении/выкупе ценных бумаг.

8.1.6. Регистр «Ценные бумаги эмитента, на казначейском торговом счете депо» - Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг эмитента под управлением Участника клиринга, приобретаемых или отчуждаемых эмитентом в процессе их обращения на торговом казначейском счете депо эмитента (лица, обязанного по ценным бумагам).

8.1.7. Регистр «Ценные бумаги у Держателя – свои» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных ценных бумаг Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.8. Регистр «Ценные бумаги у Держателя – клиенты» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.9. Регистр «Ценные бумаги у Держателя – ДУ» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.10. Регистр «Ценные бумаги у иностранного номинального держателя» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, находящихся на торговом счете депо иностранного номинального держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.11. Регистр «Ценные бумаги у иностранного уполномоченного держателя» - Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг, находящихся на торговом счете депо иностранного уполномоченного держателя в Расчетном депозитарии.

8.1.12. Регистр «Арестованные ценные бумаги» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета ценных бумаг в отношении которых получено Уведомление о наложении ареста. Регистр открывается к каждому из вышеперечисленных регистров учета ценных бумаг.

8.2. Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам

8.2.1. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам собственных сделок» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам Участника клиринга, сформированных по результатам договоров, заключенных с ценными бумагами. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению с собственного счета депо Участника клиринга, открытого в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности или ином вещном праве.

8.2.2. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам клиентских сделок» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета совокупных Обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных по поручению клиентов Участников клиринга. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению со счета депо номинального держателя, открытого Участнику клиринга в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга.

8.2.3. Регистр «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам сделок Участника клиринга, заключенных от имени своего клиента, по счету депо, которого он выступает попечителем» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по ценным бумагам лица, имеющего попечителя – Участника клиринга, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга по поручению указанного лица.

8.2.4. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга, сформированные по результатам сделок ДУ» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам, находящимся в доверительном управлении Участника клиринга, сформированных по результатам заключенных им договоров с ценными бумагами. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению со счета депо доверительного управляющего, открытого Участнику клиринга в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга.

8.2.5. Регистр «Обязательства по ценным бумагам для размещения/выкупа» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по ценным бумагам при их размещении/выкупе, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга в процессе их размещения/выкупе с использованием Раздела «к размещению/выкупу».

8.2.6. Регистр «Обязательства по ценным бумагам эмитента – казначейский» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по ценным бумагам эмитента, сформированных по результатам договоров с ценными бумагами, заключенных Участником клиринга по поручению эмитента при приобретении или отчуждении ценных бумаг в процессе их обращения.

8.2.7. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – свои у Держателя» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам Участника клиринга. Регистры формируются по обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо Держателя в Расчетном депозитарии.

8.2.8. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – клиенты у Держателя» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо номинального держателя, открытого Держателю в Расчетном депозитарии.

8.2.9. Регистры «Обязательства по ценным бумагам Участника клиринга – ДУ у Держателя» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам в доверительном управлении Участника клиринга, сформированных по результатам заключенных им договоров с ценными бумагами. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо, открытого Держателю в Расчетном депозитарии для учета ценных бумаг в доверительном управлении Участника клиринга.

8.2.10. Регистр «Обязательства по ценным бумагам – клиенты у иностранного номинального держателя» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам клиентов Участника клиринга. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо иностранного номинального держателя, открытого иностранному номинальному держателю в Расчетном депозитарии.

8.2.11. Регистр «Обязательства по ценным бумагам иностранного уполномоченного держателя» – Клиринговые регистры, предназначенные для учета Обязательств по ценным бумагам иностранного уполномоченного держателя, являющегося клиентом Участника клиринга. Регистры формируются по Обязательствам, подлежащим исполнению с торгового счета депо иностранного уполномоченного держателя, открытого иностранному уполномоченному держателю в Расчетном депозитарии.

8.3. Клиринговые регистры учета денежных средств

8.3.1. Регистр «Денежные средства Участника клиринга, зарезервированные на торги» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зарезервированных для участия в торгах в Фондовой секции и Секции МКР. Регистр соответствует торговому банковскому счету собственных средств, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации, или счету внутреннего учета средств Участника клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ. На регистре учитывается суммарное значение денежных средств, учтенных на Регистре «Денежные средства Участника клиринга – свободные» и Регистре «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные»

8.3.2. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – свободные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга свободных от Обязательств по договорам в Фондовой секции и договорам в Секции МКР.

8.3.3. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – заблокированные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета собственных денежных средств Участника клиринга заблокированных под исполнение Обязательств по договорам в Фондовой секции и Секции МКР.

8.3.4. Регистр «Денежные средства Участника клиринга, зарезервированные на торги – клиенты» – Клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга. Регистр соответствует специальному торговому счету, открытому Участнику клиринга в Расчетной организации.

8.3.5. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – свободные» – Клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга, свободных от обязательств по договорам с ценными бумагами.

8.3.6. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – заблокированные» – Клиринговый регистр, предназначенный для совокупного учета денежных средств клиентов Участника клиринга заблокированных под исполнение Обязательств по договорам с ценными бумагами.

8.3.7. Регистр «Денежные средства ГО Участника клиринга – товарный рынок – свободные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зачисленных на Клиринговый счет АО СПВБ для участия в торгах по договорам на товарном рынке, заключенных от имени и за счет Участника клиринга, и не обремененных обязательствами по заключенным договорам.

8.3.8. Регистр «Денежные средства ГО клиентов Участника клиринга – товарный рынок – свободные» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга, зачисленных на Клиринговый счет АО СПВБ для участия в торгах по договорам на товарном рынке, заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов, и не обремененных обязательствами по заключенным договорам.

8.3.9. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – товарный рынок – заблокированные для исполнения» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ, заблокированных в качестве Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, заключенных от имени и за счет Участника клиринга. На указанном регистре открываются разделы для отдельного учета заблокированного Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара.

8.3.10. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – товарный рынок – заблокированные для исполнения» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ, заблокированных в качестве Гарантийного обеспечения Договоров поставки товара, заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов. На указанном регистре открываются разделы для отдельного учета заблокированного Гарантийного обеспечения по каждому Договору поставки товара.

8.3.11. Регистр «Денежные средства Участника клиринга – товарный рынок – заблокированные на торги» - Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств Участника клиринга на соответствующем счете внутреннего учета, зарегистрированном на Клиринговом счете, для обеспечения торгового лимита по договорам с Биржевыми товарами, заключаемыми от имени и за счет Участника клиринга.

8.3.12. Регистр «Денежные средства клиентов Участника клиринга – товарный рынок – заблокированные на торги» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета денежных средств клиентов Участника клиринга на

соответствующем счете внутреннего учета, зарегистрированном на Клиринговом счете, для обеспечения торгового лимита по договорам с Биржевыми товарами, заключаемыми от имени Участника клиринга за счет его клиентов.

8.4. Клиринговые регистры по учету обязательств по денежным средствам

8.4.1. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам собственных сделок Участника клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам договоров в Фондовой секции и Секции МКР, заключенных за счет Участника клиринга.

8.4.2. Регистр «Обязательства по денежным средствам, сформированные по результатам сделок, заключенных Участником клиринга в интересах клиентов» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам договоров в Фондовой секции, заключенных Участником клиринга в интересах клиентов.

8.4.3. Регистр «Обязательства по денежным средствам, клиринговая комиссия, в рублях» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств по денежным средствам Участника клиринга, сформированных по результатам расчета комиссионного вознаграждения Клиринговой организации.

8.4.4. Регистр «Обязательства по денежным средствам Участника клиринга, сформированные по результатам сделок Участника клиринга на товарном рынке» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств Участника клиринга, по договорам с Биржевым товаром, заключенным от имени и за счет Участника клиринга.

8.4.5. Регистр «Обязательства по денежным средствам клиентов Участника клиринга, сформированные по результатам сделок Участника клиринга на товарном рынке заключенных от имени Участника клиринга за счет его клиентов» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств Участника клиринга, по договорам с Биржевым товаром, заключенных от имени Участника клиринга, за счет его клиентов.

8.4.6. Регистр «Обязательства по поставке товара Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств Участника клиринга, по договорам с Биржевым товаром, заключенных от имени и за счет Участника клиринга.

8.4.7. Регистр «Обязательства по поставке товара клиентом Участником клиринга» – Клиринговый регистр, предназначенный для учета Обязательств Участника клиринга, по договорам с Биржевым товаром, заключенных от имени Участника клиринга, но за счет и по поручению клиента Участника клиринга.

8.5. Порядок ведения клиринговых регистров

8.5.1. Начальные значения Клиринговых регистров учета ценных бумаг, описанных в подразделе 8.1 настоящих Правил клиринга, устанавливаются на основании информации, полученной от Расчетного депозитария в соответствии с договором Клиринговой организации с Расчетным депозитарием.

8.5.2. Начальные значения Клиринговых регистров учета ценных бумаг изменяются после получения повторного Отчета от Расчетного депозитария только в следующих случаях:

8.5.2.1. Расчетный депозитарий направил информацию повторно для исправления ошибок или дополнения первоначального Отчета;

8.5.2.2. После получения повторного Отчета от Расчетного депозитария по запросу Клиринговой организации;

8.5.2.3. После получения Отчета от Расчетного депозитария при изменении остатков ценных бумаг.

8.5.3. Клиринговая организация производит изменение значений Клиринговых регистров учета ценных бумаг в соответствии с Отчетами, вновь полученными от Расчетного депозитария, в течение 30 минут после получения Отчетов.

8.5.4. Взаимодействие между Клиринговой организацией и Расчетным депозитарием при изменении остатков ценных бумаг на торговых счетах депо, на Разделе «к размещению/выкупу» осуществляется в том же порядке, что и при первоначальном установлении значений Клиринговых регистров в Клиринговой системе.

8.5.5. В Клиринговые регистры учета обязательств по ценным бумагам, указанные в подразделе 8.2 настоящих Правил клиринга вносятся Нетто-обязательства и Нетто-требования по ценным бумагам, определяемые в соответствии с разделом 5 настоящих Правил клиринга. При этом Нетто-обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а Нетто-требования - с положительным.

8.5.6. Начальные значения Клиринговых регистров денежных средств, указанных в п. 8.3.1 настоящих Правил клиринга (кроме категории «В»), п. 8.3.4 настоящих Правил клиринга, устанавливаются равными величине денежных средств, находящихся на соответствующих торговых банковских счетах Участника клиринга в соответствии с данными, полученными Клиринговой организацией от Расчетной организации в порядке, установленном договором Клиринговой организации с Расчетной организацией. Начальные значения Клиринговых регистров денежных средств, указанных в п. 8.3.1 настоящих Правил клиринга для Участников клиринга категории «В» устанавливаются равными величине денежных средств на счете внутреннего учета средств Участника клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ.

8.5.7. Начальные значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.3, п.8.3.6, 8.3.9, 8.3.10 настоящих Правил клиринга устанавливаются равными состоянию этих же регистров на конец предыдущего рабочего дня.

8.5.8. Значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга (регистры для учета свободных средств) вычисляются как разница сумм, учтенных на Клиринговых регистрах, перечисленных в п. 8.5.6 настоящих Правил клиринга (регистры, отражающие текущее состояние торговых счетов), с суммами, учтенными на соответствующих Клиринговых регистрах,

перечисленных в п. 8.5.7 настоящих Правил клиринга (регистры, отражающие заблокированные средства).

8.5.9. Начальные значения Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.7, п.8.3.8 настоящих Правил клиринга устанавливаются равными величине денежных средств на счете внутреннего учета средств Участника клиринга на Клиринговом счете АО СПВБ за вычетом средств, находящихся на регистрах, указанных в п. 8.3.9, 8.3.10 настоящих Правил клиринга. Начальные значения Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12 настоящих Правил клиринга, устанавливаются равными нулю. Значения Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12 настоящих Правил клиринга, увеличиваются на суммы, указанные в Распоряжении Участника клиринга, но не более чем на значение Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.7, п.8.3.8 настоящих Правил клиринга соответственно. Одновременно с увеличением значений Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.11, п.8.3.12 настоящих Правил клиринга, на соответствующие суммы уменьшаются значения Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.7, п.8.3.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.10. Значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.5.6 настоящих Правил клиринга, изменяются каждый раз при получении от Расчетной организации новых данных о состоянии торговых банковских счетов. После чего пересчитываются значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга, в соответствии с правилом, установленным п. 8.5.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.11. Значения Клиринговых регистров, указанных в п.8.3.3, 8.3.9, 8.3.10 настоящих Правил клиринга, увеличиваются на сумму Гарантийного обеспечения по вновь заключенным договорам после получения от Биржи Реестра сделок. Значения упомянутых в настоящем пункте Клиринговых регистров уменьшаются на сумму Гарантийного обеспечения по договорам, обязательства по которым исполнены. После каждого изменения указанных регистров пересчитываются значения Клиринговых регистров, указанных в п. 8.3.2, 8.3.5 настоящих Правил клиринга, в соответствии с правилом, установленным п. 8.5.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.12. По регистрам, указанным в п. 8.3.9, 8.3.10 настоящих Правил клиринга, ведется отдельный учет по каждому Договору поставки товара (на регистрах открывается раздел для отдельного учета средств, заблокированных по каждому Договору поставки товара).

8.5.13. В Клиринговые регистры учета обязательств по денежным средствам п. 8.4.1 - 8.4.2 настоящих Правил клиринга вносятся Нетто-обязательства и Нетто-требования по денежным средствам, определяемые в соответствии с разделом 5 настоящих Правил клиринга. При этом Нетто-обязательства вносятся в регистры с отрицательным знаком, а Нетто-требования – с положительным.

8.5.14. В Клиринговые регистры учета обязательств, указанные в п.8.4.4, 8.4.5 настоящих Правил клиринга, вносятся обязательства и требования по денежным средствам по каждому Договору поставки товара отдельно. Учет

обязательства ведется в метрических тоннах с точностью, определенной Внутренними документами Биржи.

8.5.15. В Клиринговые регистры учета обязательств, указанные в п.8.4.6, 8.4.7 настоящих Правил клиринга, вносятся обязательства и требования по поставке Биржевого товара по каждому Договору поставки товара отдельно. Учет обязательства ведется в единицах изменения и с точностью, определенной Внутренними документами Биржи.

8.5.16. Клиринговые регистры, указанные в п.8.3.11, п.8.3.12 настоящих Правил клиринга, обнуляются после проведения операций по итогам торгов на Бирже, при этом средства, оставшиеся на указанных регистрах, после блокировок Гарантийного обеспечения по заключенным Договорам поставки товара возвращаются на Клиринговые регистры, указанные в п.8.3.7, п.8.3.8 настоящих Правил клиринга.

8.5.17. На основании Уведомления о взаимосвязи торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга, предоставляемого Участником клиринга в соответствии с пунктами 3.2.5.2 и 3.3.8 настоящих Правил клиринга, Клиринговая организация присваивает Участнику клиринга ТКР, однозначно определяющий взаимосвязь торгового счета депо и торгового банковского счета Участника клиринга, указанных в Уведомлении.

8.6. Реестры и иные формы внутреннего учета АО СПбБ

8.6.1. «Реестр Участников клиринга». Данный реестр формируется на основании данных, содержащихся в Анкетах Участников клиринга по форме предусмотренной в Положении о формах и форматах документов Клиринговой организации и содержит информацию по каждому Участнику клиринга, необходимую для ведения Реестра. Записи в данный Реестр производятся согласно Регламенту осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

8.6.2. «Реестр клиентов Участника клиринга». Записи в данный Реестр производятся согласно Регламенту осуществления допуска, приостановления, возобновления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

8.6.3. «Реестр остатков ценных бумаг» и «Реестр остатков денежных средств». Записи в данные Реестры производятся на основании документов, предоставляемых Клиринговой организации Расчетными депозитариями и Расчетными организациями каждый раз после получения соответствующих Отчетов.

8.6.4. «Журнал регистрации договоров об оказании клиринговых услуг». Журнал содержит информацию о номере договора, датах начала и окончания действия договора, коде и наименовании Участника клиринга. Записи в данный Реестр вносятся как в день подписания сторонами Договора об оказании клиринговых услуг, так и в дату расторжения.

8.6.5. «Реестр сделок, допущенных к клирингу». Реестр содержит информацию о дате, времени и номере реестра договоров, сформированного по итогам торгов Биржи в отношении договоров, Клиринг которых осуществляет Клиринговая организация.

8.6.6. «Реестр сделок, прошедших процедуру контроля обеспечения». Данный Реестр содержит информацию обо всех договорах, прошедших процедуру контроля обеспечения. Записи в Реестр производятся на основании Реестров договоров, результатов проверки обеспеченности и получения Отчетов от Расчетной организации и Расчетного депозитария каждый раз после проведения расчетов.

8.6.7. «Реестр сделок, исключенных из клирингового пула». Данный Реестр содержит информацию о договорах, не прошедших процедуру контроля обеспечения.

8.6.8. «Реестр распоряжений, направленных расчетной организации» и «Реестр распоряжений, направленных расчетному депозитарию». Данные Реестры содержат информацию о Распоряжениях на проведение операций по Торговым счетам, направленных в Расчетную организацию и Распоряжения на проведение операций по разделам, направленных в Расчетный депозитарий. Записи в данные Реестры производятся каждый раз после отправки Распоряжений в Расчетную организацию и Расчетный депозитарий и получения от них Отчетов об исполнении этих Распоряжений.

8.6.9. «Журнал учета отправленных отчетов». Записи в данный Журнал производятся после завершения расчетов и содержат информацию, содержащуюся в предоставленных Участнику клиринга и (или) его клиенту Отчетах.

8.6.10. Все реестры Клиринговая организация ведет в электронном виде.

8.6.11. Клиринговая организация ведет Журнал регистрации входящих документов и Журнал регистрации исходящих документов, в которых фиксируется предоставление Участниками клиринга и отправка для них документов на бумажном носителе.

8.6.12. Формы реестров и журналов, указанных в настоящем подразделе, определены во Внутренних документах Клиринговой организации.

9. Порядок представления Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга

9.1. Формы отчетов

9.1.1. Клиринговая организация формирует отчетные документы для Участников клиринга, содержащие информацию об итогах проведения Клиринга и расчетов, об Обязательствах, допущенных к Клирингу, об Обязательствах, исключенных из Клирингового пула, об Обязательствах, определенных по итогам Клиринга, об использовании индивидуального Клирингового обеспечения, об изменении суммы денежных средств в регистрах внутреннего учета, на которых учитываются денежные средства, право распоряжения которыми предоставлено

Клиринговой организации для исполнения или обеспечения исполнения Обязательств по итогам Клиринга.

9.1.2. Клиринговая организация может формировать различные формы клиринговых отчетов для обязательств, включенных в различные Клиринговые пулы.

9.1.3. Формы отчетных документов, предоставляемых Участникам клиринга, приведены в Перечне форм документов Клиринговой организации, размещенном на Официальном сайте АО СПВБ.

9.2. Порядок и сроки предоставления отчетов Участникам клиринга

9.2.1. Отчеты для Участников клиринга формируются Клиринговой организацией в электронном виде и направляются по электронной почте, указанной в Анкете Участника клиринга, не позднее пятнадцати минут после завершения расчетов.

9.2.2. Бумажные формы отчетов предоставляются уполномоченным представителям Участников клиринга или направляются почтовым отправлением по адресу, указанному в указанной в Анкете Участника клиринга с уведомлением о вручении.

9.2.3. Отчеты для клиентов Участника клиринга формируются Клиринговой организацией в электронном виде. Отчет для клиента Участника клиринга в бумажной форме, подписанный уполномоченным сотрудником Клиринговой организации, предоставляется по отдельному запросу Участника клиринга его уполномоченным представителям.

9.2.4. По соглашению сторон дополнительные формы (форматы) информации (документов и сообщений), а также способы ее передачи, определяются отдельным соглашением (отдельными соглашениями) между Клиринговой организацией и Участником клиринга.

9.2.5. Отчеты клиентам Участника клиринга и иные отчеты за предыдущие даты предоставляются по письменному запросу не позднее 3 (третьего) рабочего дня с даты получения запроса.

10. Меры, направленные на управление рисками при осуществлении клиринга

10.1. Система управления рисками

10.1.1. Клиринговая организация рассматривает управление рисками при осуществлении Клиринговой деятельности как один из важнейших элементов общей системы управления рисками Клиринговой организации. В процессе управления рисками Клиринговая организация регулярно выявляет, оценивает и контролирует угрозы и возможности, адаптирует свою деятельность с целью уменьшения вероятности и потенциальных последствий угроз.

10.1.2. Организационная структура системы управления рисками Клиринговой организации включает в себя:

10.1.2.1. Совет директоров АО СПВБ;

СПВБ;

10.1.2.2. Комитет по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ;

10.1.2.3. Бюджетный комитет АО СПВБ;

10.1.2.4. Управляющего АО СПВБ;

10.1.2.5. Правление АО СПВБ;

10.1.2.6. Риск-менеджера;

10.1.2.7. Службу внутреннего контроля;

10.1.2.8. Службу внутреннего аудита;

10.1.2.9. Руководителей структурных подразделений Клиринговой организации, отвечающих за непосредственное управление рисками и реализацию мероприятий в соответствии с Планом управления рисками.

10.1.3. В целях эффективного контроля со стороны Совета директоров АО СПВБ за системой управления рисками создан Комитет по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ (далее – Комитет по рискам), действующий на постоянной основе. Не менее половины членов Комитета по рискам составляют представители Участников клиринга.

10.1.4. Статус, компетенция, права и обязанности Комитета по рискам и его членов, состав Комитета по рискам, порядок его формирования, работы и взаимодействия с иными органами управления АО СПВБ определены в документе «Положение о Комитете по рискам и аудиту при Совете директоров АО СПВБ».

10.1.5. Управляющий АО СПВБ назначает должностное лицо, ответственное за организацию системы управления рисками Клиринговой организации (риск-менеджера), при условии, что для риск-менеджера Клиринговая организация является основным местом работы.

10.2. Документы АО СПВБ по управлению рисками

10.2.1. Управление рисками осуществляется в соответствии с «Правилами организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»».

10.2.2. Меры, принимаемые в чрезвычайных ситуациях и направленные на обеспечение непрерывности деятельности, определены в документе «План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»».

10.3. Общие принципы управления рисками

10.3.1. Система управления рисками обеспечивает основу и организационную структуру для разработки, внедрения, мониторинга, пересмотра и постоянного улучшения риск-менеджмента в масштабе Клиринговой организации.

10.3.2. Политика Клиринговой организации в области управления рисками определяется характером и масштабом операций и исходит из принципа разумной достаточности.

10.3.3. Клиринговая организация разработала комплекс мероприятий, направленных на управление рисками при осуществлении Клиринга, который включает следующие меры (но не ограничивается ими):

10.3.3.1. осуществление Клиринговой деятельности самостоятельным обособленным структурным подразделением, в исключительные функции которого входит осуществление Клиринговой деятельности;

10.3.3.2. обеспечение обособленного учета обязательств каждого Участника клиринга посредством ведения Клиринговых регистров;

10.3.3.3. формирование отчетов по итогам клиринга по договорам клирингового пула по каждому участнику клиринга и их передача участникам клиринга;

10.3.3.4. установление первоначальных требований к Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга;

10.3.3.5. исполнение обязательств по договорам на условиях «полного обеспечения»;

10.3.3.6. исполнение Обязательств по договорам (перечисление ценных бумаг по торговым счетам депо и денежных средств по Счетам) только после проверки и удостоверения (подтверждения) наличия на указанных торговых счетах достаточного количества ценных бумаг и денежных средств, предназначенных для исполнения Обязательств по договорам;

10.3.4. Для снижения уровня рисков Участников клиринга, связанных с отказом Участника клиринга от платежа, а также рисков, связанных с обстоятельствами, делающими невозможным осуществление платежа, Клиринговая организация устанавливает лимиты по допустимому объему договоров каждому Участнику клиринга, а также проводит Клиринг только по обеспеченным ценными бумагами и денежными средствами договорам, соблюдая принцип «поставки против платежа».

10.3.5. Подробный порядок действий и мер Клиринговой организации для снижения рисков устанавливается документами, указанными в подразделе 10.2 настоящих Правил клиринга.

10.4. Порядок установления лимитов по допустимому объему договоров

10.4.1. Клиринговая организация устанавливает для Участников клиринга (кроме Участников клиринга, перечисленных в п. 5 ст. 23 Федерального закона от 07.02.2011г. №7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте») лимиты по допустимому объему договоров и передает их Бирже перед началом Торговой сессии и при каждом изменении состояния торговых счетов Участников клиринга.

10.4.2. Лимит по договорам с ценными бумагами с кодом расчетов «Т0» устанавливается как по денежным средствам, так и по ценным бумагам. Допустимый объем договоров с ценными бумагами (за исключением Договоров поставки товара) устанавливается равным остатку денежных средств на торговых счетах (счетах внутреннего учета) и остатку ценных бумаг на соответствующих торговых счетах депо (разделах счетов депо на клиринговом счете депо).

10.4.3. Лимит по депозитным договорам устанавливается на основании условий Генерального соглашения и Спецификаций Биржевых инструментов, предоставленных Участниками клиринга категории «И» или категории «В».

10.4.4. Лимит по договорам с Биржевым товаром для Участников клиринга категории «Т» устанавливается равным размеру Гарантийного обеспечения договоров с Биржевым товаром, находящемуся на Клиринговых регистрах, указанных в п. 8.3.11, п. 8.3.12 настоящих Правил клиринга, умноженному на 100% и деленному на установленную п. 6.1.9 настоящих Правил клиринга величину начального Гарантийного обеспечения в процентах.

11. Определение чрезвычайных ситуаций и порядок взаимодействия с Участниками клиринга в чрезвычайных ситуациях

11.1. Чрезвычайная ситуация – это обстановка на определенной территории, сложившаяся в результате аварии, опасного природного явления, катастрофы, стихийного или иного бедствия, которые могут повлечь или повлекли за собой человеческие жертвы, ущерб здоровью людей, или окружающей среде, значительные материальные потери и нарушение условий жизнедеятельности людей. Развернутый перечень чрезвычайных ситуаций содержится в документе, указанном в п. 10.2.2. настоящих Правил клиринга.

11.2. В случае чрезвычайных ситуаций Клиринговая организация действует в порядке, установленном документом, указанным в п. 10.2.2. настоящих Правил клиринга.

11.3. В случае, если в результате чрезвычайной ситуации невозможно передать отчеты Участнику клиринга через установленные каналы связи, отчетность Участнику клиринга может быть отправлена через резервные или иные каналы связи (электронную почту, факс) или выдана в бумажном виде в помещении Клиринговой организации.

11.4. В случае, если в результате чрезвычайной ситуации остановлена Клиринговая система – Клиринговая организация информирует о прекращении работы и невозможности исполнения обязательств по итогам Клиринга до начала следующей Клиринговой сессии, используя все возможные каналы связи (в том числе телеграф, телефон, факс).

11.5. О возобновлении деятельности Клиринговой системы Участники клиринга информируются способом, предусмотренном п.9.2 настоящих Правил клиринга. Дополнительное информирование производится по факсу или телефону, указанному в Анкете Участника клиринга.

12. Оплата клиринговых услуг

12.1. Оплата услуг Клиринговой организации, оказываемых в соответствии с настоящими Правилами клиринга, осуществляется на основании Тарифов АО СПВБ.

12.2. Участник клиринга оплачивает стоимость услуг по действующим на дату оказания услуги Тарифам АО СПВБ.

12.3. Тарифы, утвержденные Советом директоров АО СПВБ, раскрываются на Официальном сайте АО СПВБ не позднее чем за 5 (пять) дней до даты их вступления в силу, если нормативными актами не установлен более длительный срок.

12.4. Оплата Участником клиринга Клиринговых услуг осуществляется по факту оказания услуг на основании счета, выставляемого Клиринговой организацией.

12.5. Выставленные Клиринговой организацией счета и акты оказанных услуг передаются Участнику клиринга способом, предусмотренным Разделом 9 настоящих Правил клиринга.

12.6. Условия оплаты по факту оказания услуг:

12.6.1. Клиринговая организация не позднее 5 (пятого) рабочего дня месяца, следующего за расчетным, выставляет Участнику клиринга счет за услуги, оказанные в течение расчетного месяца.

12.6.2. Участник клиринга обязан оплатить выставленный счет, путем перечисления денежных средств в установленном порядке на счет Клиринговой организации в размере суммы платежа, указанной в счете, в течение 10 (десяти) календарных дней с момента направления счета. При этом счет считается полученным Участником клиринга в день направления ему Клиринговой организацией счета в виде электронного документа по указанному для этих целей адресу электронной почты в Анкете Участника клиринга.

12.7. В случае, если Участник клиринга не согласен с изменением Тарифов АО СПВБ, он обязан расторгнуть Договор об оказании клиринговых услуг с Клиринговой организацией в порядке, установленном настоящими Правилами клиринга.

12.8. Если на момент вступления в силу новых Тарифов АО СПВБ Клиринговая организация не завершила оказание Клиринговых услуг такому Участнику клиринга – указанные услуги оплачиваются в соответствии с предыдущей редакцией Тарифов АО СПВБ.

12.9. В случае нарушения Участником клиринга условий оплаты счетов за оказанные клиринговые услуги Клиринговая организация имеет право приостановить оказание Клиринговых услуг Участнику клиринга до момента погашения задолженности.

12.10. В случае нарушения Участником клиринга сроков оплаты, установленных Тарифами АО СПВБ, Клиринговая организация имеет право взыскать с Участника клиринга пени в размере 0,1% (одна десятая процента) от суммы задолженности за каждый день просрочки, но не более 20% (двадцати процентов) от суммы задолженности.

12.11. Размер и порядок оплаты комиссионного вознаграждения Клиринговой организации для Банка России по операциям размещения ценных бумаг регулируется договором и предусматривает уплату такого вознаграждения на основании счетов, выставляемых Банку России и передаваемых через Личный кабинет.

13. Взаимодействие с Биржами, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием

13.1. Порядок взаимодействия с Биржами

13.1.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Биржами определяется Внутренним регламентом Клиринговой организации, если Биржа и Клиринговая организация совпадают в одном лице, или договором о взаимодействии между Биржей и Клиринговой организацией.

13.1.2. Перед началом торговой сессии Клиринговая организация передает Бирже сведения о торговых счетах, по которым могут совершаться договоры, и лимиты допустимого объема договоров по каждому торговому счету (счета внутреннего учета средств на Клиринговом счете АО СПВБ), установленные в соответствии с подразделом 10.4 настоящих Правил клиринга. Сведения передаются в виде ведомостей остатков денежных средств и ценных бумаг, учитываемых в Клиринговых регистрах. Реквизиты документов установлены Внутренним регламентом Клиринговой организации или договором между Биржей и Клиринговой организацией.

13.1.3. В случае совмещения АО СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью Биржи положения об обмене данными между Клиринговой организацией и Биржей означают обмен данными между отдельными структурными подразделениями АО СПВБ, занимающимися осуществлением клиринговой деятельностью и деятельностью по организации торговли.

13.1.4. Клиринговая организация передает Бирже лимиты допустимого объема договоров всякий раз при их изменении.

13.1.5. Биржа передает Клиринговой организации Реестр договоров. Реквизиты Реестра договоров устанавливаются Внутренним регламентом Клиринговой организации или договором между Биржей и Клиринговой организацией.

13.1.6. Клиринговая организация направляет Бирже информацию об Участниках клиринга и получает от Биржи информацию об Участниках торгов в объеме и порядке, установленном договором между Биржей и Клиринговой организацией или Внутренним регламентом Клиринговой организации.

13.1.7. Иные случаи взаимодействия с Биржей установлены в соответствующих разделах настоящих Правил клиринга.

13.2. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией

13.2.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Расчетной организацией определяется договором о взаимодействии.

13.2.2. Клиринговая организация передает Расчетной организации Уведомление о регистрации нового Участника клиринга. Указанное Уведомление является условием для проведения операций, согласно Распоряжению, направляемому в Расчетную организацию Клиринговой организацией после проведения Клиринга.

13.2.3. Расчетная организация информирует Клиринговую организацию об открытии торгового банковского счета в порядке, установленном договором о взаимодействии.

13.2.4. Расчетная организация открывает Клиринговой организации Клиринговый счет после заключения с Клиринговой организацией соответствующего договора. Расчетная организация информирует Клиринговую организацию об открытии Клирингового счета в письменном виде.

13.2.5. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при обмене информацией о состоянии торговых и клиринговых счетов установлен подразделом 5.1 настоящих Правил.

13.2.6. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при совершении операций по торговым и клиринговым счетам установлен подразделами 5.5, 7.2 и 7.4 настоящих Правил клиринга.

13.2.7. Порядок взаимодействия с Расчетными организациями при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 настоящих Правил клиринга.

13.2.8. В случае прекращения Клирингового обслуживания Участника клиринга, расторжения Договора с Участником клиринга Клиринговая организация уведомляет об этом Расчетную организацию в письменной форме. Дополнительно уведомление может быть направлено по электронной почте или факсу.

13.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием.

13.3.1. Порядок взаимодействия Клиринговой организации с Расчетным депозитарием определяется договором о взаимодействии. Наименования Расчетных депозитариев:

13.3.1.1. Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД);

13.3.1.2. Закрытое акционерное общество «Санкт-Петербургский Расчетно-Депозитарный Центр» (ЗАО «СПб РДЦ»).

13.3.2. Для возможности открытия торговых счетов депо с указанием Клиринговой организации Клиринговая организация передает в Расчетный депозитарий Уведомление о регистрации нового Участника клиринга. Указанное Уведомление является условием для открытия Расчетным депозитарием торгового счета депо с указанием Клиринговой организации в качестве клиринговой организации, с согласия или по поручению которой совершаются операции по торговому счету. Открытие торгового счета депо производится в соответствии с Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария. Расчетный депозитарий информирует Клиринговую организацию об открытии торгового счета депо в порядке, установленном для обмена информацией о состоянии торговых счетов.

13.3.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при обмене информацией о состоянии торговых счетов депо, Раздела «к размещению/выкупу» установлен подразделами 5.1 и 5.5 настоящих Правил клиринга.

13.3.4. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при совершении операций по торговым счетам депо, Разделу «к размещению/выкупу» установлен подразделами 5.5 и 7.3 настоящих Правил клиринга.

13.3.5. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при проведении сверки расчетов установлен подразделами 5.6 и 5.7 настоящих Правил клиринга.

13.3.6. В случае прекращения Клирингового обслуживания Участника клиринга, расторжения Договора с Участником клиринга Клиринговая организация уведомляет об этом Расчетный депозитарий в письменной форме. Дополнительно уведомление может быть направлено по электронной почте или факсу.

13.3.7. Расчетный депозитарий имеет право закрыть торговые счета депо, открытые с указанием Клиринговой организации в качестве клиринговой организации, которая вправе давать Распоряжения по этим счетам, только после получения от Клиринговой организации согласия на закрытие указанных торговых счетов депо. Получение согласия не требуется, если Клиринговая организация уведомила Расчетный депозитарий о расторжении Договора с Участником клиринга, торговые счета которого закрываются.

Договор № _____
об оказании клиринговых услуг

г. Санкт-Петербург

«___» _____ 20__ г.

Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», действующее в качестве клиринговой организации на основании лицензии № 040-00005-000010 от «20» декабря 2012 г., выданной Федеральной службой по финансовым рынкам, именуемое в дальнейшем **Клиринговая организация**, в лице _____ действующего на основании _____, с одной стороны, и _____, именуемое в дальнейшем **Участник клиринга**, в лице _____, действующего на основании _____, с другой стороны, совместно именуемые «Стороны» заключили настоящий Договор о нижеследующем:

1. **Клиринговая организация** обязуется оказывать **Участнику клиринга** услуги по проведению клиринга, а **Участник клиринга** оплачивать указанные услуги. Условия предоставления указанных услуг определяются Правилами клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее по тексту Правила клиринга).

2. Подписывая настоящий Договор, **Участник клиринга** принимает условия Правил клиринга в целом и обязуется надлежащим образом исполнять все установленные в них обязательства и требования.

3. Настоящий Договор вступает в силу с момента его подписания обеими Сторонами.

Реквизиты и подписи сторон:

АО СПВБ

Участник клиринга